第一图书网, tushu007.com

<<财务危机动态预警模型研究>>

图书基本信息

书名：<<财务危机动态预警模型研究>>

13位ISBN编号：9787313072337

10位ISBN编号：7313072333

出版时间：2011-6

出版时间：上海交通大学出版社

作者：孙晓琳

页数：155

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：http://www.tushu007.com

内容概要

《财务危机动态预警模型研究》由孙晓琳编著，以“企业的财务危机具有持续性特点和累积效应”为出发点，综合运用滤波理论、财务危机动态预警理论和MATLAB编程技术，从时间序列角度和横截面角度建立了基于
Kalrman滤波的财务危机动态预警模型和BP神经网络的预警模型，对企业财务危机的动态预警理论和方法进行了系统深入的研究，并采用大样本、多变量、长时间序列的数据进行实证研究。
本书建立的理论依据，可以作为企业开展财务危机预警提供动态实时的决策辅助工具。

《财务危机动态预警模型研究》可作证券市场和上市公司分析人员的参考用书，可供高等院校相关专业的科研工作者、研究生参考。

书籍目录

第1章 绪论
1. 1 研究背景及问题的提出
1. 1. 1 研究背景
1. 1. 2 问题的提出
1. 2 研究的目的和意义
1. 3 国内外研究现状及分析
1. 3. 1 财务危机概念界定的研究现状
1. 3. 2 财务危机预警模型的研究现状
1. 3. 3 财务危机预警指标体系的研究现状
1. 3. 4 财务危机预警实证研究的现状
1. 3. 5 国内外研究现状评述
1. 4 本书的内容、方法和技术路线
1. 4. 1 研究内容
1. 4. 2 主要研究方法
1. 4. 3 技术路线
第2章 财务危机动态预警的理论基础
2. 1 财务危机的内涵
2. 1. 1 财务危机和财务危机预警的界定
2. 1. 2 财务危机的特征
2. 1. 3 财务危机的原因分析
2. 2 动态预警的理论基础
2. 2. 1 预警理论
2. 2. 2 企业生命周期理论
2. 2. 3 质量过程控制理论
2. 3 引发财务危机的影响因素分析
2. 3. 1 财务状况恶化对财务危机的影响
2. 3. 2 经营质量降低对财务危机的影响
2. 3. 3 公司治理结构对财务危机的影响
2. 4 动态预警指标体系的确定及定义
2. 5 本章小结
第3章 财务危机预警动态数据分析与检验
3. 1 样本公司的选择
3. 1. 1 样本公司选择的依据
3. 1. 2 样本的选择
3. 1. 3 样本公司选择结果
3. 2 动态系统数据的统计描述和检验
3. 2. 1 动态系统数据的描述性统计和噪声预处理
3. 2. 2 时间序列数据的参数检验和非参数检验
3. 2. 3 变量间相关性分析
3. 2. 4 动态系统数据空间维度的确定
3. 3 公司治理截面数据的统计描述和检验
3. 4 动态系统数据的标准正态化处理
3. 5 全局主成分分析动态系统数据
3. 5. 1 全局主成分法
3. 5. 2 分析结果

3. 6 本章小结
第4章 基于Kalman滤波构建企业财务危机预警模型
4. 1 动态系统的状态空间描述
4. 1. 1 时间序列分析
4. 1. 2 状态空间模型
4. 2 Kalman滤波算法
4. 2. 1 Kalman滤波
4. 2. 2 扩展Ka|man滤波
4. 3 Kalman滤波在财务危机预警中的适用性分析
4. 3. 1 应用Kalman滤波的研究现状
4. 3. 2 Kalman滤波在财务危机预警中的适用性
4. 4 财务危机预警状况空间模型的建立.
4. 5 极大似然估计在模型参数辨识中的应用
4. 5. 1 极大似然估计
4. 5. 2 参数辨识
4. 6 本章小结
第5章 动态模型有效性的分析与检验
5. 1 分警度的财务危机阈值的确定
5. 1. 1 不同警度的判定标准
5. 1. 2 不同警度划分的结果
5. 1. 3 预警阈值的确定
5. 2 Kalman滤波模型结果的动态分析
5. 2. 1 检测样本的财务状态结果
5. 2. 2 检测样本的财务预测结果
5. 2. 3 模型结果的动态分析与讨论
5. 3 总体判别正确率分析
5. 3. 1 预测精度的分析
5. 3. 2 模型分类识别能力的检验
5. 4 本章小结
第6章 公司治理视角下的BP神经网络财务危机预警模型
6. 1 公司治理研究视角的完善
6. 1. 1 公司治理指标的引入
6. 1. 2 新近上市公司的特点
6. 1. 3 神经网络的优势
6. 2 BP神经网络的基本概念
6. 2. 1 神经元模型
6. 2. 2 BP神经网络及其结构
6. 3 BP神经网络的设计和创建
6. 3. 1 BP神经网络的设计
6. 3. 2 BP神经网络的创建
6. 4 BP神经网络的训练和仿真结果
6. 4. 1 BP神经网络的训练
6. 4. 2 BP神经网络的仿真及结果分析
6. 5 两种财务危机动态预警模型的对比分析
6. 6 本章小结
第7章 结论与展望
7. 1 结论

第一图书网, tushu007.com

7．2 进一步研究的方向
附录
附录1 样本公司信息
附录2 备选财务指标和经营指标的描述性统计
附录3 备选财务指标的非参数检验
附录4 备选财务指标的Person检验
附录5 备选治理指标的描述性统计
附录6 备选治理指标的非参数检验
附录7 备选财务指标的全局主成分分析
附录8 Matlab主程序内容
参考文献
后记

第一图书网, tushu007.com

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:http://www.tushu007.com