

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

图书基本信息

书名：<<金融市场的波动行为与波动机理>>

13位ISBN编号：9787564213916

10位ISBN编号：7564213914

出版时间：2012-6

出版时间：上海财经大学出版社有限公司

作者：李红权

页数：191

字数：222000

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>

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

内容概要

金融市场是一类有人参与的开放复杂巨系统，“波动外生论”的观点无法解释市场行为的复杂性与涌现特征，探讨市场不稳定性的内生机制是其必然要求。

《金融市场的波动行为与波动机理——基于计算金融与行为金融的联合视角》从计算金融学、行为金融学、复杂性科学的融合角度系统研究了金融市场的波动行为与波动机理，揭示了市场参与主体的行为异质性和互动机制，开发了更有现实解释能力的计算金融学模型，深入分析了金融泡沫与金融危机的产生机制。

《金融市场的波动行为与波动机理——基于计算金融与行为金融的联合视角》提供了一套认识、理解及干预金融市场波动行为的基于行为的、可计算的理论分析体系。

本书由李红权著。

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

作者简介

李红权，男，1976年出生。

湖南大学管理学博士。

现执教于湖南师范大学商学院金融系，兼任湖南大学中科预测科学研究中心研究员、湖南省管理科学学会金融专业委员会副主任。

主要研究领域为金融工程与金融风险管理、金融复杂性研究。

先后在《中国管理科学》，《系统工程理论与实践》、《财经研究》及 "Internati-onal.

Journalof

Information Technol—ogyand Decision

Making " 等国内外期刊上发表论文20余篇；主持和参与国家自然科学基金、社会科学基金等国家级项目4项及省部级项目3项，获得省部级科研奖励3项。

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

书籍目录

序

第1章 绪论

- 1.1 研究动因及研究意义
- 1.2 经典金融学理论的观点及其局限性
- 1.3 本书的研究思路与内容安排

第一篇 金融市场波动行为的本质特征

第2章 金融市场的复杂波动行为：基于非线性动力学视角的分析

- 2.1 研究动因与理论评述
- 2.2 研究设计与数据特征
- 2.3 股价随机游走与独立性的实证研究
- 2.4 股价波动的分形动力学与长期记忆效应研究
- 2.5 股价波动的混沌动力学特征研究
- 2.6 本章小结

第二篇 金融市场为何波动

第3章 金融市场的波动：基于行为金融学与计算金融学的解释

- 3.1 引言
- 3.2 金融市场复杂波动行为的内在机理：一个综合评述
- 3.3 正反馈机制及其行为金融学解释
- 3.4 投资者的异质性与相互影响：来自异质交易者模型的解释

第4章 异质交易者、噪声与市场波动：一个计算金融学模型

- 4.1 引言
- 4.2 模型
- 4.3 计算机模拟结果与统计特征
- 4.4 模型参数的敏感性分析
- 4.5 本章小结

第5章 金融投机泡沫的成因与启示：以美国次贷危机为例

- 5.1 引言
- 5.2 引发次贷金融泡沫的外部环境
- 5.3 美国次贷金融泡沫的内在形成机制
- 5.4 美国次贷金融泡沫的启示
- 5.5 金融危机的后续影响：金融监管变革与金融产品消费者保护

第6章 金融市场间的互动与传染：开放经济下的系统性风险

- 6.1 引言
- 6.2 金融互动和传染的界定及其关联
- 6.3 国际金融市场间危机传染的根源和机制
- 6.4 本章小结

第7章 我国A股市场与美股、港股的互动与传染关系研究

- 7.1 引言
- 7.2 广义Granger因果关系与信息溢出检验方法
- 7.3 实证研究与结果分析
- 7.4 本章小结

第三篇 如何理性应对金融市场的波动行为

第8章 基于价格极差的金融波动率建模：理论与实证分析

- 8.1 研究动因
- 8.2 波动率建模研究

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

8.3 数据与模型参数估计

8.4 模型预测效果评价

8.5 本章小结

第9章 计算金融学与政策模拟：金融监管政策的分析框架

9.1 引言

9.2 人工金融市场与计算金融学：模型与演进

9.3 基于人工金融市场的经济政策模拟研究

9.4 本章小结

第10章 基于人工金融市场的监管政策模拟研究：以证券交易税为例

10.1 引言

10.2 研究方法和模型设计

10.3 仿真市场结果分析

10.4 本章小结

第11章 总结与展望

参考文献

附录主要的计算机程序目录

后记

<<金融市场的波动行为与波动机理>>

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>