

<<中国股市分形结构>>

图书基本信息

书名：<<中国股市分形结构>>

13位ISBN编号：9787306026811

10位ISBN编号：730602681X

出版时间：2006-3

出版时间：中山大学

作者：黄诒蓉

页数：241

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>

## <<中国股市分形结构>>

### 内容概要

《中国股市分形结构：理论与实证》主要利用分形理论及大量的统计方法对中国股市存在的分形结构进行全面、系统、深入的研究，在理论研究基础上，进行了大量的实证分析。全书分5大部分：对分形理论进行系统的阐述；中国股市的单分形结构研究；对分形特征之一的长期记忆特性构建分形差分模型进行理论研究和实证分析；进一步对中国股市的多重分形结构进行研究；利用分形特征对传统资本市场理论进行一定程度的修正，提出分形资本市场理论。适合职业股市研究者参考分析之用。

## &lt;&lt;中国股市分形结构&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 导论	1.1 问题提出及意义	1.2 文献综述	1.2.1 国外文献综述	1.2.2 国内文献综述	1.2.3 对国内研究局限性的评述	1.3 研究方法	1.4 本书结构	1.5 研究数据及处理																	
第2章 分形理论	2.1 分形理论的创立、发展及意义	2.2 分形是什么?	2.3 分形例子	2.3.1 Cantor集	2.3.2 Koch曲线	2.3.3 Sierpinski望	2.4 分形特征	2.4.1 自相似性	2.4.2 标度不变性	2.4.3 分形维	2.4.4 局部随机性和整体确定性共存	2.5 分形类型	2.5.1 严格分形和随机分形	2.5.2 空间分形和时间分形	2.5.3 自相似分形和自仿射分形	2.5.4 简单分形和多重分形	2.6 分形理论与混沌理论比较	2.7 分形市场理论	2.7.1 有效市场理论及其局限性	2.7.2 分形市场的基本内涵	2.7.3 分形市场理论的重要意义	2.7.4 对股市分形结构的诠释			
第3章 中国股市单分形结构研究	3.1 分形布朗运动	3.1.1 分形布朗运动的定义	3.1.2 分形布朗运动的基本性质	3.1.3 分形布朗运动的分形特征	3.2 中国股市非线性实证检验	3.2.1 正态性检验	3.2.2 线性相关性检验	3.2.3 非线性相关性检验	3.2.4 股市收益的易变性期限结构分析	3.3 中国股市R/S分析	3.3.1 经典R/S分析方法	3.3.2 修正R/S分析方法	3.3.3 实证结果	3.4 中国股市分形维分析	3.4.1 分形维的概念及意义	3.4.2 实证研究	3.5 中国股市分形分布分析	3.5.1 分形分布	3.5.2 中国股市分形分布实证研究	3.6 中国股市非线性动力学分析	3.6.1 理论与方法	3.6.2 估计结果及分析	3.7 研究结论及局限性	3.7.1 研究工作及结论	3.7.2 亟需进一步研究的问题
第4章 分形差分模型研究	4.1 分形差分噪声与长期记忆过程	4.2 理论模型	4.2.1 ARFIMA ( $n, d, s$ ) 模型	4.2.2 FIGARCH ( $p, d, q$ ) 模型	4.2.3 模型汇总	4.3 模型的估计、检验与预测	4.3.1 模型参数的估计方法	4.3.2 模型的检验方法与选择准则	4.3.3 模型的预测效果评价	4.4 基于中国股市的实证研究	4.4.1 上证指数日收益序列的长期记忆特性分析	4.4.2 基于GPH和ARFIMA ( $0, d, 0$ ) 的分形差分参数估计	4.4.3 基于MLE的模型估计	4.5 研究结论及有待进一步研究的问题											
第5章 中国股市多重分形结构研究	5.1 多重分形理论概述	5.1.1 多重分形测度和过程	5.1.2 广义Hurst指数	5.1.3 局部Holder指数和多重分形谱	5.2 中国股市多重分形结构的实证检验	5.2.1 多重分形的实证检验方法	5.2.2 中国股市多重分形结构的实证结果	5.3 股票收益的多重分形模型	5.3.1 股票收益多重分形模型的内容	5.3.2 股票收益多重分形模型的性质	5.3.3 多重分形模型与以往模型比较	5.4 本章总结及研究展望	5.4.1 总结	5.4.2 对多重分形研究的展望											
第6章 分形资本市场理论	6.1 现代资产组合理论与分形资产组合理论	6.1.1 现代资产组合理论及其局限性	6.1.2 分形资产组合理论	6.2 期权定价理论与分形期权定价理论	6.2.1 期权定价理论及其局限性	6.2.2 分形期权定价理论																			
第7章 总结与展望	7.1 本书创新之处	7.2 研究结论	7.3 意义	7.3.1 对研究者的启示	7.3.2 对股市投资分析者的启示	7.3.3 对股市调控者和监管者的启示	7.3.4 对风险管理者的启示	7.3.5 对中国股市存在明显分形结构的现实解释	7.4 有待进一步研究的问题	7.4.1 分形结构分析方法的研究	7.4.2 高频数据分形结构的进一步研究	7.4.3 股票收益多重分形模型的实证研究	7.4.4 各类模型比较研究	7.4.5 分形结构的应用研究											
附录参考文献																									

## <<中国股市分形结构>>

### 编辑推荐

本书主要利用分形理论及大量的统计方法对中国股市存在的分形结构进行全面、系统、深入的研究，在理论研究基础上，进行了大量的实证分析。

全书分5大部分：对分形理论进行系统的阐述；中国股市的单分形结构研究；对分形特征之一的长期记忆特性构建分形差分模型进行理论研究和实证分析；进一步对中国股市的多重分形结构进行研究；利用分形特征对传统资本市场理论进行一定程度的修正，提出分形资本市场理论。

适合职业股市研究者参考分析之用。

<<中国股市分形结构>>

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>