第一图书网, tushu007.com

<<基于多重分形的金融市场复杂特性分析>>

图书基本信息

书名：<<基于多重分形的金融市场复杂特性分析及应用>>

13位ISBN编号：9787513608879

10位ISBN编号：7513608873

出版时间：2012-1

出版时间：中国经济出版社

作者：苑莹　等著

页数：272

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

本书围绕金融市场复杂陸问题进行了深入探索，在对分形与多重分形理论系统分析的基础上，作者对中国沪深股票市场进行了实证研究。
全书对复杂性问题基本理论做了全面总结，系统研究了中国股票市场的异象性特征及多重分形特性，探讨了股票市场多重分形特征在风险管理中的应用，同时，作者深入研究了中国股票市场的极端波动行为。
全书体例严谨，数据翔实，为新时期下探索金融市场复杂特性的优秀之作。

作者简介

苑莹，管理学博士。
副教授，现任教于东北大学工商管理学院。
东北大学信息科学与工程学院博士后，美国德克萨斯大学奥斯汀分校McCombs商学院访问学者。
近几年来，在Physica
A：Statistical Mechanics and its Applications,The Journal of
Business and
Economics，《系统工程学报》。
《管理工程学报》，《系统管理学报》，《管理评论》，《管理科学》等国际国内学术期刊上发表论文二十余篇。
作为项目负责人主持国家自然科学基金，中国博士后科学基金，中国博士后特别资助等科研项目多项，翻译出版《金融与保险精算数学》译著一部，编写《金融保险实务》教材一部。

庄新田，管理学博士，教授，博士生导师，现任教于东北大学工商管理学院。
近年来，在中外核心期刊发表学术论文120余篇，其中SCI收录5篇，EI收录15篇，ISTP收录10篇；主持国家及省部级科研课题20余项，获奖8项。

书籍目录

前言
第1章 绪论
1.1 非线性框架下研究中国股票市场价格行为的现实背景
1.2 非线性框架下研究中国股票市场价格行为的理论背景
1.3 分形市场理论的提出
1.4 将多重分形理论应用于中国股票市场的重要意义
第2章 金融市场
2.1 金融市场概述
2.2 金融市场基本理论
2.2.1 投资组合理论
2.2.2 资本资产定价模型
2.2.3 资本市场微观结构理论
2.2.4 资本市场风险管理技术
2.2.5 金融市场波动的传统理论与方法
2.3 本章小结
第3章 复杂性理论及方法
3.1 分形理论
3.1.1 分形的提出
3.1.2 分形的定义
3.1.3 分形例子
3.1.4 分形特征
3.1.5 分形维数
3.1.6 分形类型
3.2 分形市场理论
3.2.1 分形市场的含义
3.2.2 分形市场的特征
3.2.3 分形市场理论与有效市场理论的比较
3.2.4 分形市场理论的意义
3.2.5 对股市分形结构的诠释
3.3 多重分形理论
3.3.1 多重分形理论的产生
3.3.2 多重分形概念
3.3.3 多重分形测度及多重分形过程
3.3.4 多重分形的时变性参数
3.3.5 多重分形谱
3.3.6.资产收益率多重分形模型
3.4 混沌理论
3.4.1 混沌的定义
3.4.2 混沌的基本特征
3.4.3 混沌理论的产生
3.4.4 混沌实例
3.4.5 混沌经济系统的度量
3.5 复杂性方法
3.5.1 自相似性和标度不变性
3.5.2 稳定分布与负幂律分布

3.5.3 多标度与多重分形
3.5.4 自相关函数与自相关指数
3.5.5 Hurst指数
3.5.6 消除趋势波动分析
3.5.7 盒计数法
……
第4章 金融市场的异象性特征
第5章 中国股票市场的多重分形特性研究
第6章 多重分形特性在金融风险管理中的应用
第7章 结论、启示与展望
参考文献
附录

章节摘录

3.2.1 分形市场的含义　　分形市场理论将分形理论引入金融市场有效性和金融市场结构的研究当中，为金融市场的研究建立了一个新的理论框架。
FMH认为，一个分形市场包含以下几方面的含义：　　（1）资本市场由数目众多的投资者组成，而且每一个投资者具有不同的投资期限；　　（2）不同的市场信息对投资者产生不同的影响，短期投资者更注重历史信息，而长期投资者更关注基本信息；　　（3）资本市场的稳定性主要取决于其流动性，不同的投资期限、信息集和接近市场公认的公平价格确保了市场的充分流动性，从而稳定了整个资本市场；　　（4）价格反映了短期技术分析与长期基本分析的结合；　　（5）如果某项资产与经济周期循环无关，那么它就不具有长期趋势，其波动主要由交易量、流动性和短期信息决定。
　　……

第一图书网, tushu007.com
<<基于多重分形的金融市场复杂特性分析>>

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