

<<金融复杂系统>>

图书基本信息

书名：<<金融复杂系统>>

13位ISBN编号：9787030167439

10位ISBN编号：7030167430

出版时间：2006-1

出版时间：科学出版社

作者：范英

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>

## &lt;&lt;金融复杂系统&gt;&gt;

## 内容概要

《金融复杂系统:模型与实证》从复杂系统的观点出发,研究了金融市场中的风险管理、分形特征、动力学性质等学术热点问题,对于认识风险的本质,理解金融市场演化的机理,预测风险的变化,增强抵御风险的能力具有重要的理论价值和现实意义。

《金融复杂系统:模型与实证》的内容分为三部分,第一部分讲述了度量金融风险的VaR方法,将成熟的EWMA方法应用于中国股市风险值的预测,并提出了一种新的VaR的预测方法---EDFMST方法,既保留了历史模拟法对收益率的分布不做任何假定的特点,又克服了该方法对历史数据相等权重不能及时反映最新信息的不足,解决了选择历史数据长度上的两难问题;第二部分将分形、混沌的理论应用到中国股市的分析中,得到沪市和深市的分形特征和动力学特征,为进一步建立中国股票市场的动力学模型奠定了理论基础;第三部分将复杂性研究工具之一的元胞自动机应用于金融市场,构建了资本市场演化模型,提出了投资行为市场容量和离散度的概念,从而实现了对市场的稳定性以及远离平衡的均衡等复杂行为的量化,研究了资本市场的涌现现象,通过模拟实验探讨了市场的复杂性,研究了投资心理和宏观因素对股市演化的影响,揭示了这两个影响因素在资本市场中所扮演的重要角色。最后以兖州煤业股票市场为例进行了实证研究。

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>