

<<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>