

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

图书基本信息

书名：<<金融市场中传染风险建模与分析>>

13位ISBN编号：9787030361073

10位ISBN编号：7030361075

出版时间：2012-12

出版时间：科学出版社

作者：何建敏，李守伟，周伟 著

页数：361

字数：535000

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>

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

内容概要

何建敏、李守伟、周伟所著的《金融市场中传染风险建模与分析》主要针对金融市场中传染风险进行建模，进而进行仿真或实证分析，通过定性与定量相结合对传染风险进行剖析，挖掘其形成规律和演化特征。

全书分为六个部分。

第一部分主要介绍研究背景及相关研究现状。

第二部分以银行间市场为例，基于复杂网络理论研究金融市场中离散型传染风险及其演化模型。

第三部分以期货市场为例，研究金融市场中连续型传染风险测度模型，并进行实证分析。

第四部分以信用风险转移市场为例，研究金融市场中信用型传染风险形成机制、度量模型、行为影响因素以及演化模型。

第五部分以股票市场为例，基于复杂动力网络理论研究金融市场中行为型传染风险演化模型。

第六部分是全书的研究总结和展望。

《金融市场中传染风险建模与分析》可供从事金融学科领域研究的高校教师、研究生、金融监管人员及各类金融机构的决策者和研究人员参考。

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

书籍目录

前言

第一部分 绪论

第1章 绪论

- 1.1 研究背景与意义
- 1.2 金融市场中传染风险相关研究现状
- 1.3 本书的研究内容及结构安排

第二部分 金融市场中离散型传染风险建模与分析

第2章 离散型传染风险研究基础

- 2.1 离散型传染风险概念
- 2.2 相关理论与方法基础
- 2.3 小结

第3章 银行间市场分层网络模型的构建

- 3.1 银行间市场网络的形成
- 3.2 分层网络模型的构建
- 3.3 网络模型的拓扑结构测度
- 3.4 小结

第4章 基于分层网络的离散型传染风险分析

- 4.1 银行间传染风险分析过程
- 4.2 基于分层网络的传染风险仿真分析
- 4.3 传染风险对银行间市场网络结构的影响
- 4.4 基于传染风险的银行间市场稳定性分析
- 4.5 小结

第5章 分层网络演化中的离散型传染风险

- 5.1 分层网络演化模型
- 5.2 银行主体行为动态分析
- 5.3 网络演化中传染风险分析
- 5.4 小结

第三部分 金融市场中连续型传染风险建模与分析

第6章 连续型传染风险研究基础

- 6.1 价格收益与价格波动
- 6.2 连续型传染风险概念及其产生机制
- 6.3 相关理论与方法基础
- 6.4 小结

第7章 低频数据下的连续型传染风险建模与分析

- 7.1 连续型传染风险测度的一般模型
- 7.2 多元时变传染风险模型的构建、内涵及其参数求解
- 7.3 小结

第8章 高频数据下的连续型传染风险建模与分析

- 8.1 金融市场中高频数据的概念及其统计特征
- 8.2 超高频数据久期模型及其扩展
- 8.3 超高频数据下连续型传染风险测度模型构建
- 8.4 小结

第9章 金属期货市场中连续型传染风险实证研究

- 9.1 金属期货市场分析
- 9.2 低频数据下期货市场中连续型传染风险测度实证

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

9.3 高频数据下期货市场中连续型传染风险测度实证

9.4 小结

第四部分 金融市场中信用型传染风险建模与分析

第10章 信用型传染风险相关概念

10.1 信用型传染风险概念

10.2 CRT市场中信用型传染风险形成机制

10.3 小结

第11章 CRT市场中信用型传染风险度量模型研究

11.1 对数Gauss衰减的信用风险传染模型与CDO定价研究

11.2 基于滤子理论的信用风险传染模型研究

11.3 小结

第12章 信用风险持有者情绪、流动性与信用型传染风险研究

12.1 信用风险传染的行为分析

12.2 基于持有者情绪下的信用风险传染模型

12.3 模型的理论分析

12.4 仿真模拟分析

12.5 小结

第13章 CRT市场中信用型传染风险演化行为研究

13.1 博弈学习理论下BCRT策略选择的演化行为研究

13.2 信用风险传染的非线性动力学行为与演化研究

13.3 基于非线性复杂动力学的信用风险传染行为与演化研究

13.4 小结

第五部分 金融市场中行为型传染风险建模与分析

第14章 行为型传染风险研究基础

14.1 行为型传染风险概念

14.2 相关理论与方法基础

14.3 小结

第15章 基于复杂动力网络的行为型传染风险演化过程分析

15.1 股市羊群行为内涵的复杂动力网络理论解析

15.2 复杂动力网络结构下的股市羊群行为演化特征

15.3 基于复杂动力网络的股市投资网络模型构建及分析

15.4 小结

第16章 基于网络近邻择优策略的行为型传染风险演化模型及仿真

16.1 网络近邻择优策略下股市羊群行为演化规则

16.2 网络近邻择优策略下股市羊群行为演化的平均场解析

16.3 网络近邻择优策略下股市羊群行为演化过程特征的理论解析

16.4 网络近邻择优策略下股市羊群行为演化过程特征的仿真分析

16.5 小结

第17章 基于网络协调博弈策略的行为型传染风险演化模型及仿真

17.1 网络协调博弈策略下股市羊群行为演化规则

17.2 网络协调博弈策略下股市羊群行为演化的平均场解析

17.3 投资行为策略风险占优对股市羊群行为演化的影响

17.4 股市网络拓扑结构特征对股市羊群行为演化的影响

17.5 小结

第18章 基于网络反协调博弈策略的行为型传染风险演化模型及仿真

18.1 网络反协调博弈策略下股市羊群行为演化规则

18.2 网络反协调博弈策略下股市羊群行为演化的平均场解析

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

18.3 投资行为策略风险占优对股市羊群行为演化的影响

18.4 股市网络拓扑结构特征对股市羊群行为演化的影响

18.5 小结

第六部分 总结与展望

第19章 总结与展望

19.1 总结

19.2 研究展望

参考文献

<<金融市场中传染风险建模与分析>>

编辑推荐

《金融市场中传染风险建模与分析》的写作和研究中，主要根据金融市场不同，其产生的传染风险性质不同为基本出发点，考虑不同类型传染风险，再结合不同的模型与方法进行理论结合实际的系统研究。

从风险显著发生的不同性质出发，分别研究了金融市场中存在的“离散型传染风险”和“连续型传染风险”；从特色金融产品出发，研究了金融市场中存在的“信用型传染风险”；从金融市场中普遍存在的羊群效应出发，研究了金融市场中存在的“行为型传染风险”。

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>