

<<虚拟经济波动复杂性>>

图书基本信息

书名：<<虚拟经济波动复杂性>>

13位ISBN编号：9787310037964

10位ISBN编号：7310037960

出版时间：2011-11

出版时间：南开大学

作者：李俊青

页数：211

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>

<<虚拟经济波动复杂性>>

内容概要

本书的核心命题是虚拟经济呈现出的非线性复杂性。

全书共九章，第一章介绍系统复杂性的概念及经济系统复杂性的表现。

第二章说明经济虚拟化过程以及虚拟资本、虚拟经济的本质特征。

第三章实证分析中国证券市场价格波动的统计特征，描述虚拟资产价格波动的复杂性。

第四章描述中国证券市场存在的价格波动积聚性，以揭示股票的长期和短期记忆性。

第五章描述虚拟经济研究的另一个重要领域——在房地产市场的投资动力方程中存在的混沌和非线性特征。

第六章从心理学角度解释虚拟经济存在复杂性基础。

第七章描述资产定价的历史脉络，介绍虚拟资产定价最重要的理论和模型。

第八章解释虚拟经济出现混沌等复杂现象背后的非线性机理。

第九章介绍虚拟经济(主要为证券和房地产市场)演化控制的理论模型和理论政策建议。

全书贯穿了虚拟经济运行的微观层面研究的思路，试图从虚拟经济运行机理上剖析虚拟经济价格波动的产生原因、运行特点和控制方式。

<<虚拟经济波动复杂性>>

书籍目录

前言

第一章 系统复杂性

1.1 系统复杂性——一个自然科学的描述

1.2 复杂系统

1.3 经济系统及其复杂性

1.4 本章 小结

第二章 虚拟经济

2.1 财富

2.2 经济虚拟化

2.3 虚拟经济波动复杂性

2.4 本章 小结

第三章 中国证券市场价格统计特征分析

3.1 收益率分布的非正态与非自相似

3.2 价格波动的期限结构与不稳定市场

3.3 收益率的局部统计分析

3.4 本章 小结

第四章 中国证券市场价格波动持续性分析

4.1 波动持续性

4.2 波动持续性的R / S检验

4.3 多元GARCH模型及其建模研究

4.4 本章 小结

第五章 房地产投资复杂性分析

5.1 房地产虚拟性与价格波动

5.2 房地产投资系统动力学模型的建立与识别

5.3 基于混沌理论的房地产投资模型演化行为分析

5.4 基于投资模型演化行为的综合技术水平分析

5.5 本章 小结

第六章 理性主义和心理学

6.1 理性主义

6.2 有限理性

6.3 心理学

6.4 本章 小结

第七章 资产定价

7.1 有效市场假说和鞅过程

7.2 演绎型资产定价理论

7.3 归纳型资产定价理论

7.4 本章 小结

第八章 虚拟经济的非线性动力学

8.1 物理经济学

8.2 基于投资者心理和不同投资者类型的模型

8.3 基于心理的模型

8.4 基于异质主体的模型

8.5 本章 小结

第九章 虚拟经济系统控制

9.1 证券市场的GCMG(GRAND CANONICAL MINORITY GA)模型

<<虚拟经济波动复杂性>>

9.2分析

9.3房地产投资模型的混沌控制

9.4本章 小结

附录I稳定分布

附录2一元时间序列模型

附录3重标极差分析R / S法

附录4.1 Q统计量

附录4—2 BDS检验

附录5多元GARCH模型

附录6多元GARCH模型参数估计的传统算法-

参考文献

<<虚拟经济波动复杂性>>

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>