第一图书网, tushu007.com

<<资本市场非线性行为研究>>

图书基本信息

书名：<<资本市场非线性行为研究>>

13位ISBN编号：9787504938183

10位ISBN编号：7504938181

出版时间：2006-4

出版时间：中国金融出版社

作者：王德河

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

本书包括绪论、资本市场理论发展历史的回顾及方法论分析、非线性系统与耗散结构、资本市场的动力学因素分析、资本市场价格运动的动力学框架和特征、资本市场价格运动的混沌动力特性分析、资本市场价格运动分形特征的R/S分析、总结与前瞻共八章，比较全面地论述了资本市场的结构和影响资本市场价格变化的各种动力学因素，明确指出资本市场是一个高度开放远离均衡的非线性复杂系统，是不断演化和动态稳定的“活”的机体，给出了资本市场价格运动的一般动力学模型，阐明了作者对管理当局应发挥怎样的作用的观点。
不仅如此，本书还有效地对资本市场分析中使用较多的R/S分析法进行了改进，展望了非线性资本市场理论的发展前景及有待进一步研究的问题。
本书有理论，有实证，构成了一个完整的逻辑系统。
本书适合作为资本市场从业人员、高校师生的学习参考用书。

书籍目录

第一章 绪论 第一节 研究背景、意义及目的 第二节 文献综述 第三节 研究思路和结构安排 第四节 创新点第二章 资本市场理论发展历史的回顾及方法论分析 第一节 资本市场理论发展历史的回顾 第二节 主流资本市场理论的基本假设、观点和缺陷 第三节 资本市场研究的方法论问题及主流理论失灵的根源 第四节 资本市场是高度开放的非线性复杂系统 第五节 资本市场属于耗散结构第三章 非线性系统与耗散结构——一般概念和原理 第一节 系统、结构和功能 第二节 决定论和概率论的描述 第三节 自组织与耗散结构 第四节 分形与混沌 第五节 分形时间序列及R/S分析法 第六节 相空间分形维、时间序列分形维及其与赫斯特指数的关系第四章 资本市场的动力学因素分析 第一节 投资者及投资者行为 第二节 投资期限和信息对投资行为的影响 第三节 个人投资者的投资心态和投资理念 第四节 委托代理关系与机构投资者投资 第五节 其他利益相关者行为对市场价格的影响 第六节 市场规则及政策对证券价格变化的影响 第七节 投资行为的反馈特性第五章 资本市场价格运动的动力学框架和特征 第一节 反馈机制和原理 第二节 资本市场价格运动的动力学模式框架 第三节 一个简单的数学反馈模型 第四节 对价格动力学模型的讨论 第五节 资本市场价格运动的一般运动学描述第六章 资本市场价格运动的混沌动力特性分析 第一节 市场价格时间序列的趋势消解 第二节 相空间重构及塔肯斯（Takens）定理 第三节 李雅甫诺夫（Lyapunov）指数 第四节 国内外学者对资本市场分形维与李雅甫诺夫（Lyapunov）指数的求解情况第七章 资本市场价格运动分形特征的R/S分析 第一节 方法论 第二节 数据的选取及说明 第三节 在整个区间作回归的结果 第四节 改进方法得到的结果 第五节 对结果的分析和说明第八章 总结与前瞻 第一节 主要结论及成果 ……参考文献后记

第一图书网, tushu007.com

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