

<<股价波动复杂性机制研究>>

图书基本信息

书名：<<股价波动复杂性机制研究>>

13位ISBN编号：9787115262745

10位ISBN编号：7115262748

出版时间：2011-9

出版时间：人民邮电出版社

作者：尤晨

页数：179

字数：150000

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>

## <<股价波动复杂性机制研究>>

### 内容概要

《股价波动复杂性机制研究——基于交易者心理的视角》(作者尤晨博士)分别从市场交易者数量变动、从众行为、价格的心理预期以及股票供求关系等角度分析和研究了价格波动复杂性的内在机理,利用MATLAB语言编程对所得到的证券市场价格波动非线性动力学模型进行了计算机仿真,在模型的计算、仿真和实证分析的基础上,提出了相应的对股市进行宏观调控的政策建议。

《股价波动复杂性机制研究——基于交易者心理的视角》适合研究证券市场的专家与学者、证券市场从业人员及高等院校相关专业师生阅读参考。

## <<股价波动复杂性机制研究>>

### 作者简介

尤晨，中国矿业大学管理科学与工程博士，南京大学工商管理博士后，现任漳州师范学院管理科学系副教授，兼任漳州吉马印刷职业技术学院特聘教授，曾主持和参与完成国家自然科学基金、省级社科项目多项。

在国内外学术刊物上发表论文40余篇，主要研究方向为区域品牌、产业经济、系统工程。

2000年以来，曾为以下企业提供过咨询或培训服务：深圳德仁堂医药有限公司、九江美庐乳业、香港维新集团、武汉豪强装饰工程有限公司、仙桃恒迪地产公司、天安保险股份有限公司、徐州维维集团股份有限公司、福建长富乳业集团、福建九九王有限公司、漳州晶祥贝壳纽扣有限公司、漳州华安旅游开发有限公司、深圳艺境园林设计与规划公司等。

# <<股价波动复杂性机制研究>>

## 书籍目录

### 第1章 绪论

- 1.1 复杂性科学的研究背景及意义
  - 1.1.1 复杂性科学研究动态
  - 1.1.2 资本市场理论范式的转变
  - 1.1.3 研究中存在的问题
- 1.2 研究目标与内容
  - 1.2.1 研究目标
  - 1.2.2 研究内容
- 1.3 本章小结

### 第2章 股票市场复杂性存在的判据及表征

- 2.1 复杂性系统的基本特征
  - 2.1.1 非线性与动态性
  - 2.1.2 非周期性与开放性
  - 2.1.3 初值敏感性
  - 2.1.4 奇怪吸引子
  - 2.1.5 自相似性和分形性
- 2.2 复杂系统复杂性的判定方法
  - 2.2.1 系统混沌的定性判别方法
  - 2.2.2 系统混沌的定量判别方法
- 2.3 沪深股市实证分析
  - 2.3.1 沪深股市的R / S分析
  - 2.3.2 Lvapunov指数分析
  - 2.3.3 结论
- 2.4 股票市场复杂性表现特征
  - 2.4.1 股票市场的非线性与动态性
  - 2.4.2 证券市场的非周期性与开放性
  - 2.4.3 金融危机的初值敏感性
  - 2.4.4 价格序列的奇怪吸引性与分形性
  - 2.4.5 股票市场的长期记忆效应
  - 2.4.6 股票市场的突现现象
  - 2.4.7 股票市场中的自组织自适应行为
- 2.5 本章小结

### 第3章 股价波动复杂性产生的心理学机制分析

- 3.1 投资者行为理论的心理学基础
  - 3.1.1 情感心理学
  - 3.1.2 认知心理学
  - 3.1.3 社会群体心理学
- 3.2 关于投资主体复杂决策的研究
  - 3.2.1 模糊逻辑
  - 3.2.2 行为心理学
  - 3.2.3 投资决策的不确定性因素
- 3.3 投资决策过程的复杂性分析
  - 3.3.1 决策模型
  - 3.3.2 决策过程的复杂性描述
- 3.4 我国投资者决策复杂性的实证分析

## <<股价波动复杂性机制研究>>

- 3.4.1 实验内容及设计
- 3.4.2 部分实验结果及分析
- 3.4.3 结论
- 3.5 本章小结

### 第4章 投资者心理对价格波动复杂性的影响建模与分析

- 4.1 股票市场中心理因素对价格的影响
  - 4.1.1 投资心理乘数
  - 4.1.2 投资偏好
  - 4.1.3 嫌贵贪低心理
  - 4.1.4 从众心理
  - 4.1.5 心理价位
- 4.2 基于从众心理的价格模型
  - 4.2.1 从众心理对股价波动的影响
  - 4.2.2 Lux的传染模型
  - 4.2.3 从众心理与价格波动关系模型
  - 4.2.4 从众心理对股票供求与价格的影响
  - 4.2.5 结论
- 4.3 基于心理预期的价格波动模型
  - 4.3.1 心理预期与价格的相互作用
  - 4.3.2 基于市场预期的非线性动力学模型
  - 4.3.3 模型中混沌发生的条件
  - 4.3.4 仿真结果
  - 4.3.5 结论与建议

### 第5章 投资者行为对价格波动复杂性的影响

- 5.1 交易行为模型
  - 5.1.1 Schmidt的市场流动性模型
  - 5.1.2 模型的改进
  - 5.1.3 Lyapunov指数分析
- 5.2 价格不变假设下的模型研究
  - 5.2.1 价格不变假设下的模型
  - 5.2.2 Lyapunov指数分析
- 5.3 计算机仿真
- 5.4 本章小结

### 第6章 结论与相关建议

- 6.1 主要结论
- 6.2 本书的创新
- 6.3 对我国股票市场发展的一些建议
  - 6.3.1 投资者心理素质的引导
  - 6.3.2 完善证券市场监管
  - 6.3.3 对股市复杂性进行控制

### 参考文献

<<股价波动复杂性机制研究>>

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>