

<<资本市场的混沌与秩序>>

图书基本信息

书名：<<资本市场的混沌与秩序>>

13位ISBN编号：9787505814486

10位ISBN编号：7505814486

出版时间：1999-3

出版时间：经济科学出版社

作者：埃德加·E·彼得斯

页数：210

字数：280000

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>

<<资本市场的混沌与秩序>>

内容概要

《资本市场的混沌与秩序》是介绍和推广混沌理论在金融领域中的应用的第二本书，并被奉为这方面的经典论著。

这次新版在内容上进行了全面的更新，加入了一些新的章节和混沌理论的最新进展进行了论述。这些最新进展都是与当今的创新热点紧密联系的，如模糊逻辑、神经网络和人工智能。

第二版全面论述了混沌理论在金融领域的作用。

它所利用的都是当今市场的最新例证并对技术的最新进展 - 包括遗传算法、小波和复杂理论 - 进行了描述。

<<资本市场的混沌与秩序>>

书籍目录

丛书序言 中文版序言 第二版前言 致谢前言 第一篇 新的范式 第一章 引言：生活可以如此复杂 复杂本书的结构 第二章 随机游动与有效市场 有效市场假说 (EMH) 的发展历史 现代资产组合理论 小结 第三章 线性范式的失灵 正态性的检验 易变性的奇特行为 风险/收益率交换 市场是否有效 为什么尾部是肥胖的 简化假定的危险 第四章 市场与混沌：偶然性与必然性 偶然性与必然性能否共存 第二篇 资本市场的分形结构 第五章 分形简介 分形形状 随机分形 混沌游戏 第六章 分形维 小结 第七章 分形时间序列——有偏随机游动 赫斯特指数 赫斯特的模拟技术 赫斯特指数 (H) 的分形性质 估计赫斯特指数 赫斯特的经验法则 分形维与赫斯特指数 (H) 赫斯特指数 (H) 估计量在多大程度上有效 太阳黑子周的R/S分析 小结 第八章 资本市场的R/S分析 方法 股票市场 债券市场 通货 经济指数 含意 第九章 分形统计学 帕雷托 (分形) 分布 “输掉的” 经济学 稳定性检验 加法不变性 易变性有多么稳定 小结 第十章 分形和混沌 洛吉斯蒂克方程 通向混沌之路 出生与死亡 遵循有序速率的无序 洛吉斯蒂克方程的分形性质 小结 第三篇 非线性动力学 第十一章 非线性动力学简介 动力学系统释义 相空间 (Phase Space) 埃农映射 洛吉斯蒂克延滞方程 (The Logistic Delay Equation) 控制参数 李雅普诺夫指数 第十二章 时间序列的动力学分析 重构相空间 分形维 (The Fractal Dimension) 李雅普诺夫指数 第十三章 资本市场的动力学分析 消除数据的趋势 分形维 李雅普诺夫指数 含意 打乱检验 这意味着什么 第四篇 与复杂共存 第十四章 协同市场假说 瓦加的非线性统计模型 协同系统 社会模仿理论 协同市场假说 控制参数 瓦加的实施方法 对于协同市场假说的批评 第十五章 分数真理：模糊逻辑和行为金融学 模糊逻辑 行为心理学 易得性启发法的偏差 代表性启发法的偏差 锚系和调整启发法的偏差 一个模糊——行为——分形假说 第十六章 应用混沌学和非线性方法 IBS资本管理公司 预测公司 TIB合伙公司 PANAGORA资产管理公司 小结 第十七章 展望未来：走向一个更普遍的方法 简化假定 时间的流逝 相互依赖性和独立性 再论均衡 其他可能性 小结 附录 关于软盘及附录1~5 (略) 附录6 互联网络资源名词解释索引 译者后记

<<资本市场的混沌与秩序>>

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>