

## <<大宗商品价格波动与风险分析>>

### 图书基本信息

书名：<<大宗商品价格波动与风险分析>>

13位ISBN编号：9787513014885

10位ISBN编号：7513014884

出版时间：2012-10

出版单位：知识产权出版社

作者：吴振信，王书平 著

页数：237

字数：308000

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>

## <<大宗商品价格波动与风险分析>>

### 内容概要

本书分别利用变化协调相关性检验、ARIMA-GARCH函数、IS-LM-BP-O模型、小波分析、人工神经网络和Copula连接函数等数量经济方法，研究了心理因素和重大突发事件对国际油价波动的影响，油价波动与经济增长和货币政策之间的关系，以及铜铝期货价格波动的特征、趋势预测和风险度量，供决策者、管理者和感兴趣的学者参考。

## <<大宗商品价格波动与风险分析>>

### 作者简介

吴振信，1962年10月生，北方工业大学经济管理学院教授，经济研究所所长，中国数量经济学会常务理事，中国优选法统筹法与经济数学研究会理事。

1985年毕业于中国科学院研究生院，获理学硕士学位，1988年赴加拿大温莎大学（University of Windsor）做访问学者。

主要从事金融及衍生品研究和低碳经济研究，在《数量经济技术经济研究》、《管理世界》、《中国管理科学》、International

Management

Review等刊物上公开发表学术论文70余篇，出版专著和教材12部，主持完成多项科研项目，其中3项获部级奖励。

王书平，1977年9月生，汉族，湖南涟源人，经济学博士，副教授，现任北方工业大学经济管理学院副院长，兼任中国优选法统筹法与经济数学研究会理事、《中国管理科学》稿件评审专家。

2006年毕业于中国人民大学经济学院，获经济学博士学位，同年进入北方工业大学经济管理学院工作，2010年入选北京市中青年骨干教师。

主要从事大宗商品定价、计量经济分析方面的研究工作，对石油价格的非市场影响因素进行了比较深入的分析，在一定程度上解决了非市场因素不可度量的问题。

近年来，在Lecture

Notes in Computational

Science、《系统工程理论与实践》、《中国管理科学》等期刊上发表学术论文60余篇，主持完成教育部人文社会科学研究项目等科研项目3项。

书籍目录

第一章 投资者心理因素对国际石油价格波动的影响研究

第一节 引言

第二节 石油期货市场代表性启发式心理和过度反应的实证检验

第三节 过度自信心理对石油期货短期和长期价格的影响分析

第四节 锚定心理对石油期货短期和长期价格的影响分析

第五节 过度自信、锚定心理及羊群行为的一个综合的模型

第六节 研究结论

第二章 重大突发事件对国际油价波动的影响研究

第一节 引言

第二节 石油工人罢工对国际油价的影响分析

第三节 墨西哥湾飓风对国际油价的影响分析

第三章 国际油价波动对我国经济非对称性影响研究

第一节 引言

第二节 相关理论与模型

第三节 变量选取与模型构建

第四节 实证分析

第五节 研究结论

第四章 油价波动与货币政策关系研究

第一节 引言

第二节 净出口函数模型构建及实证检验

第三节  $IS-LM-BP$ 模型的扩展

第四节  $IS-LM-BP-O$ 模型

第五节 研究结论

第五章 我国铜铝期货价格波动的长期记忆性研究

第一节 引言

第二节 长期记忆性相关模型

第三节 模型构建与实证分析

第四节 研究结论

第六章 基于小波理论的期铜价格周期波动研究

第一节 引言

第二节 期铜市场及期铜价格影响因素分析

第三节 期铜价格波动周期性分析

第四节 基于小波一时间序列组合模型的期铜价格预测

第五节 研究结论

第七章 基于GLAR和ANN的期铜价格非线性集成预测

第一节 引言

第二节 影响沪铜价格因素的实证检验

第三节 沪铜价格序列分解及各分量的因素分析

第四节 沪铜价格预测模型的构建和实证分析

第五节 研究结论

第八章 基于Copula理论的金融风险度量研究

第一节 引言

第二节 copula的理论基础

第三节 次贷危机后国际股票市场相关性变动的copula分析

第四节 基于copula理论的投资组合VaR度量研究

第五节 研究结论

<<大宗商品价格波动与风险分析>>

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>