

<<金融波动理论.方法及其应用>>

图书基本信息

书名：<<金融波动理论.方法及其应用>>

13位ISBN编号：9787560982366

10位ISBN编号：7560982360

出版时间：2012-9

出版时间：华中科技大学出版社

作者：周少甫

页数：285

字数：250000

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>

## <<金融波动理论.方法及其应用>>

### 内容概要

内容提要全书主要包括：园林工程施工准备阶段监理，园林土方工程监理，园路、园桥与广场工程监理，园林绿化工程监理，园林古（仿古）建筑工程监理，园林水体工程监理，园林假山置石工程监理，园林供电工程监理等。

本书注重对园林工程监理员管理能力和专业技术能力的培养，力求做到文字通俗易懂，叙述内容简单明了，有助于监理工作的规范化，增强了可操作性，可作为园林绿化工程施工管理人员、监理人员常备的操作手册。

<<金融波动理论.方法及其应用>>

作者简介

周少甫，湖北天门人。

1985年毕业于华中师范大学数学系，获理学学士学位；1994年毕业于武汉大学数学系，获概率统计专业硕士学位；2000年毕业于华中科技大学数学系，获概率统计专业博士学位。

现为华中科技大学经济学院副教授。

近五年来，在《数量经济技术经济研究》、《统计研究》、《公共管理学报》、《中国人口资源与环境》等学术刊物上发表论文十余篇；承担国家自然科学基金项目2项，主持省部级社科基金项目1项。

主要研究方向：数量经济学、金融计量和金融工程。

## &lt;&lt;金融波动理论.方法及其应用&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第1章 绪论

## 1.1 研究背景与意义

## 1.1.1 选题背景

## 1.1.2 波动率的基本特性

## 1.1.3 我国股票市场的发展状况

## 1.1.4 研究意义

## 1.2 文献综述

## 1.2.1 广义自回归条件异方差模型和随机波动率模型

## 1.2.2 波动指数的理论和Copula技术

## 1.3 结构安排与主要工作

## 1.3.1 结构安排

## 1.3.2 主要创新

## 第2章 多元GARCH模型

## 2.1 几种常用的多元GARCH模型

## 2.1.1 多元GARCH模型

## 2.1.2 对角多元GARCH模型

## 2.1.3 BEKK模型

## 2.1.4 CCG-多元GARCH模型

## 2.1.5 DCC\_多元GARCH模型

## 2.2 树结构多元GARCH模型的贝叶斯分析

## 2.2.1 树结构多元GARCH模型及其先验描述

## 2.2.2 树结构多元GARCH模型的贝叶斯推断

## 2.2.3 贝叶斯模型平均

## 2.3 实证分析

## 2.3.1 沪、深、港三地股票市场数据的特征

## 2.3.2 树结构模型构建及实证结果

## 2.4 本章小结

## 第3章 随机波动模型

## 3.1 基本波动模型及其扩展

## 3.1.1 基本的随机波动模型

## 3.1.2 带厚尾的随机波动模型

## 3.1.3 受外生因素影响的随机波动模型

## 3.1.4 门限随机波动模型(THSV)

## 3.1.5 长记忆性的随机波动模型

## 3.1.6 连续时间的随机波动模型

## 3.2 随机波动模型的估计

## 3.2.1 一般随机波动模型的MCMC估计

## 3.2.2 其他估计方法

## 3.3 实证分析

## 3.3.1 上海、深圳股市指数收益的杠杆效应

## 3.3.2 多元长记忆SV模型及其在沪深股市的应用

## 3.4 本章小结

## 第4章 波动的非对称性溢出效应分析

## 4.1 ASVDJ模型介绍

## 4.1.1 基于ASVDJ模型的波动率估计

## <<金融波动理论.方法及其应用>>

- 4.1.2 牛熊态势划分方法
- 4.1.3 模型数据来源及说明
- 4.2 消息冲击对股市波动影响的实证研究
  - 4.2.1 初始值和数据输入
  - 4.2.2 算法及估计结果
  - 4.2.3 结果分析
  - 4.2.4 ASV模型和EGARCH模型比较
  - 4.2.5 行为金融学解释
- 4.3 GC-MSV模型介绍
  - 4.3.1 沪深300股指期货合约
  - 4.3.2 GG-MSV模型估计
  - 4.3.3 数据来源和说明
- 4.4 股指期货对股市波动溢出效应分析
  - 4.4.1 先验分布模型算法
  - 4.4.2 波动溢出效应检验
  - 4.4.3 模型估计结果
- 4.5 本章小结
- 第5章 波动指数理论
  - 5.1 VIX指数简介
    - 5.1.1 VIX指数的编制方式
    - 5.1.2 VIX指数的用途
    - 5.1.3 总结与启示
  - 5.2 我国波动指数编制方案
    - 5.2.1 波动指数编制指标选择
    - 5.2.2 波动指数编制方案设计
  - 5.3 已实现波动率估计
    - 5.3.1 已实现波动率简介
    - 5.3.2 已实现波动率的自相关修正法
    - 5.3.3 超高频数据的序列相关性分析
  - 5.4 我国波动指数CV序列实证分析
    - 5.4.1 长记忆性研究概述
    - 5.4.2 波动指数统计特征分析
    - 5.4.3 基于长记忆性建模与预测
    - 5.4.4 波动指数序列长记忆性建模分析
  - 5.5 本章小结
- 第6章 波动指数的相关性分析
  - 6.1 波动指数的功能
    - 6.1.1 市场情绪的评定标准
    - 6.1.2 投资决策的参考指标
  - 6.2 Copula模型介绍
    - 6.2.1 Copula函数的定义
    - 6.2.2 Copula函数的基本性质
    - 6.2.3 Copula函数的分类
    - 6.2.4 Copula函数的估计与选择
  - 6.3 Copula理论相关性测度及其应用
    - 6.3.1 Copula理论的相关性测度
    - 6.3.2 尾部相依性与Copula函数

<<金融波动理论.方法及其应用>>

6.4 波动指数与股指收益同期相关性实证分析

6.4.1 数据

6.4.2 实证分析

6.4.3 模型估计结果的评价

6.4.4 波动指数预测功能评估——基于均值一方差模型

6.5 动态条件Copula模型波动指数预测功能检验

6.5.1 动态条件Copula理论

6.5.2 动态条件Copula模型的分类

6.5.3 动态条件Copula在金融分析上的应用

6.5.4 波动指数与股指收益率间的相关性分析——基于动态Copula模型

6.6 本章小结

## <<金融波动理论.方法及其应用>>

### 编辑推荐

《金融波动理论、方法及其应用》的内容建立在2003年诺贝尔经济学奖获得者美国经济学家Engle以及国内外著名计量经济学家工作的基础之上，其理论部分属波动理论中的国际前沿研究方向，其实证研究属国内波动性研究方向的创新成果，部分成果已发表在《数量经济技术经济研究》、《统计研究》等杂志。

全书共六章节，内容包括绪论、多元GARCH模型、随机波动模型、波动的非对称性溢出效应分析、波动指数理论等。

本书可作为数量经济学、统计和金融工程等领域研究生的教学参考书。

<<金融波动理论.方法及其应用>>

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>