第一图书网, tushu007.com

<<金融物理学导论>>

图书基本信息

书名：<<金融物理学导论>>

13位ISBN编号：9787810988865

10位ISBN编号：7810988867

出版时间：2007-6

出版时间：上海财经大学

作者：周炜星

页数：271

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

第一图书网, tushu007.com

<<金融物理学导论>>

内容概要

本书的出发点是科研导向的，涉及很多有争议的问题，这些问题往往是进一步研究的起点。笔者也不时发表自己的看法，并作出评论，读者无需认同书中所论述的观点、方法或理论，完全可以用自己的观点来认识和解释。

从这个意义上来说，本书可为刚刚接触金融物理学这一交叉学科的研究生和科研人员作有效的指引，也可供金融物理学家参考。

另一方面，由于笔者水平所限，本书无意对金融物理学进行包罗万象的介绍，对一些十分重要的问题只能忍痛割爱，如随机矩阵理论、财富分布、企业生长模型等。

本书若能抛砖引玉，对促进我国金融物理学的发展有所裨益，笔者的目的也就达到了。

第一图书网, tushu007.com

作者简介

周炜星，浙江诸暨人。
2001年5月华东理工大学毕业，获工学博士学位。
2001年6月至2004年5月在美国加利福尼亚大学洛杉矶分校师从Sornette教授进行博士后研究。
已在Journal of Macroeconomics、Quantitative Finance、Physical Review E、Physica A、Proceedings of the Royal Society B等国际学术期刊上发表文章三十余篇，科研成果在国际上有广泛影响，研究成果曾被国际著名学术性媒体New Scientists、Financial Times、Physics World、News@Nature、Science Now等报道，在《参考消息》上也曾转发报道。
2003年获全国优秀博士论文提名(未得奖)，2004年获上海市优秀博士论文奖。

第一图书网, tushu007.com

<<金融物理学导论>>

书籍目录

序前言第一章 金融市场第一节 金融市场简介一、金融市场的功能与分类二、中国股市第二节 有效市场假说和市场异象一、市场有效性的三种形式二、一月效应三、月度效应四、周末效应五、周五兼十三号效应六、节日效应七、日内效应八、小公司效应九、均值回复第三节 金融物理学一、金融物理学的定义二、研究内容三、程式化规律第二章 价格波动的概率分布第一节 概率论基础第二节 布朗运动模型一、随机游走　二、巴舍利耶模型第三节 列维平稳分布　一、帕雷托定律二、列维平稳定律　三、平稳帕雷托市场四、参数估计　五、截尾列维飞行模型第四节 变方差混合正态模型　一、从属正态模型二、有限方差从属模型　三、学生氏分布模型四、概率分布的演化第五节 幂律尾分布　一、收益率的负三次方定律二、波动率的分布　三、其他变量的尾分布四、无标度区第六节 拉伸指数分布模型　一、分阶排序法二、拉伸指数分布第三章 长期记忆性和时间相关性第一节 分数布朗运动和自相似随机过程　一、数学基础二、模拟分数布朗运动的算法第二节 霍斯特分析　一、传统的霍斯特分析二、算法……第四章 金融市场的多重分形特性第五章 金融泡沫和反泡沫的建模和预测第六章 市场微观模型第七章 复杂系统灾变动力学参考文献中英文对照

第一图书网, tushu007.com

<<金融物理学导论>>

编辑推荐

《金融物理学导论》若能抛砖引玉，对促进我国金融物理学的发展有所裨益，笔者的目的也就达到了。

第一图书网, tushu007.com

<<金融物理学导论>>

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