

图书基本信息

书名：<<金融市场多标度理论建模及其风险管理应用>>

13位ISBN编号：9787811139822

10位ISBN编号：7811139820

出版时间：2011-6

出版时间：湖南大学出版社

作者：杨宏林

页数：126

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>

## <<金融市场多标度理论建模及其风险管理应用>>

### 内容概要

金融市场多标度条件下所表现出来的明显区别于单一标度的行为特征和动力学机制，对于更深层次地把握金融市场的内在本质，以及认识金融风险的复杂性和产生根源至关重要。

由杨宏林编著的《金融市场多标度理论建模及其风险管理应用》以金融市场时间标度为切入点，系统研究金融市场多标度波动的理论建模及其风险管理问题。

通过对金融市场多标度统计分布、临界标度、相关性和层次结构等行为特征的准确刻画，发掘隐含于金融市场多标度条件下波动的内在结构和微观机理，获得多标度波动级串间的传递方向和关联特征；设计基元分割概率和随机分割数等控制参量来涵盖多标度特征，构建离散多标度波动随机级串模型，进而计算多标度波动矩和协方差阵，研究资产多标度风险度量和控制；《金融市场多标度理论建模及其风险管理应用》并将研究成果应用到多标度风险度量和投资组合优化领域，促进金融市场波动建模理论和风险管理实践的创新与发展。

书籍目录

第1章 绪论

- 1.1 研究意义与问题的提出
  - 1.1.1 研究意义
  - 1.1.2 问题的提出
- 1.2 国内外研究现状及评述
  - 1.2.1 金融市场多标度行为特征的国内外研究现状及评述
  - 1.2.2 金融市场多标度建模的国内外研究现状及评述
  - 1.2.3 金融市场风险管理的国内外研究现状及评述
  - 1.2.4 已有研究的总结
- 1.3 研究思路和方法
- 1.4 研究内容与主要创新点
  - 1.4.1 研究内容
  - 1.4.2 主要创新点
- 1.5 结构安排与技术路线

第2章 金融市场多标度幂律特征和临界现象

- 2.1 收益率多标度条件下的幂律特征
  - 2.1.1 收益率的中心分布
  - 2.1.2 收益率的尾部分布
- 2.2 收益率多标度条件下的临界现象
- 2.3 本章小结

第3章 金融市场多标度条件下的相关性特征

- 3.1 金融市场多标度条件下的幂相关性
  - 3.1.1 不同收益率序列的时变特征
  - 3.1.2 收益率序列多标度条件下的幂相关性分析
- 3.2 金融市场多标度的幂律分布与相关性关联研究
  - 3.2.1 幂律分布的变化对于相关性的影响
  - 3.2.2 特定类型的相关性对于幂律分布的影响
- 3.3 本章小结

第4章 金融市场多标度自相似性和层次结构特征

- 4.1 多标度的自相似性
  - 4.1.1 自相似性——结构函数的标度指数
  - 4.1.2 扩展自相似性——相对结构函数的相对标度指数
  - 4.1.3 广义扩展自相似性——归一化相对结构函数广义相对标度指数
- 4.2 多标度的层次结构特征
  - 4.2.1 波动相关关系三维特征结构
  - 4.2.2 S1层次结构模型
- 4.3 本章小结

第5章 金融市场多标度条件下波动的级串方向和结构

- 5.1 多标度条件下波动的因果关系
  - 5.1.1 多标度条件下波动的单位根检验
  - 5.1.2 多标度条件下波动的因果关系检验
- 5.2 多标度条件下波动级串结构的方向
  - 5.2.1 利用交叉相关系数分析多标度条件下波动的传递方向
  - 5.2.2 利用功率谱分析多标度条件下波动的传递方向
- 5.3 多标度条件下波动级串结构概念图

5.4 本章小结

第6章 金融市场多标度离散随机分割级串模型

6.1 金融市场离散随机波动级串模型构建

6.1.1 金融市场离散随机波动模型构建原理

6.1.2 金融市场离散随机波动模型的构建

6.2 金融市场波动级串模型控制参数的讨论

6.3 金融市场波动级串模型的Monte-Carlo仿真比较

6.4 最优金融市场级串模型与经验数据的比较

6.5 本章小结

第7章 金融市场多标度条件下的风险模型

7.1 基于多标度条件下波动级串模型的风险分散化原理

7.2 单一资产多标度条件下的风险分散化模型

7.3 本章小结

结论

参考文献

编辑推荐

《金融市场多标度理论建模及其风险管理应用》围绕目前金融领域中新的热点问题——多标度波动理论建模及其风险管理应用展开研究。

在对金融市场多标度行为特征系统研究的基础上，通过发掘隐含在金融市场多标度条件下的内在微观结构和控制机理，构建出多标度波动模型，研究资产多标度条件下的风险度量和控制问题。

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>