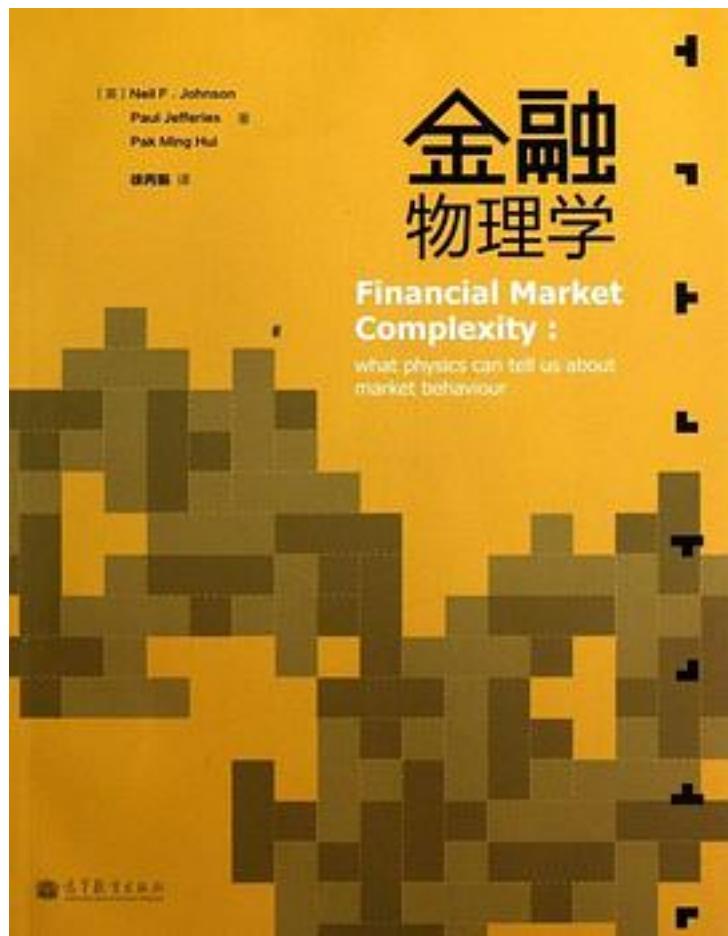


金融物理学



[金融物理学 下载链接1](#)

著者:约翰逊

出版者:

出版时间:2011-7

装帧:

isbn:9787040314786

《金融物理学》主要内容：金融市场是“行为复杂性”中最令人迷醉的例子，它是真实世界中的复杂系统，其演化方式由众多交易者的决策结果所决定，交易者们都试图在这场巨大的全局“博弈”中赢利。《金融物理学》从当今最流行的学科——复杂性和复杂

系统中吸取了最新的概念，来说明如下几方面的问题：金融市场的行为如何；为什么金融市场要以这样的方式运行；如果知道金融市场的这些行为，为了将金融风险减小到最低程度，我们能够做些什么。在有关金融市场动力学的几个似乎无伤大雅的假设基础上，人们建立起来了标准的金融理论。《金融物理学》将会说明在解决重要的实际问题时，这些假设会给出令人误解的答案。这些实际问题包括降低金融风险、预测金融危机和股市暴跌之类的极端事件以及对衍生产品进行定价等。

作者介绍：

目录: 第一章 金融市场是一个复杂系统

§ 1.1 金融中的实际问题

§ 1.2 复杂系统和复杂性

§ 1.3 金融市场概述

§ 1.4 观察市场

第二章 标准金融理论

§ 2.1 标准金融理论中存在的问题

§ 2.2 随机游走

§ 2.3 风险：意想不到的厚尾现象

§ 2.4 在Black-Scholes期权定价理论框架内消除风险

第三章 沿华尔街的复杂行走

§ 3.1 面对程式化事实

§ 3.2 统计工具和数据包

§ 3.3 经验分析

§ 3.4 挑战标准理论

§ 3.5 面向一般随机过程的理论框架

§ 3.6 市场中的时间关联效应

第四章 具有全局相互作用的金融市场模型

§ 4.1 自下而上的建模方法

§ 4.2 两人成伴，三人成群

§ 4.3 “去不去酒吧？”

§ 4.4 从酒吧到市场

§ 4.5 模型选择

§ 4.6 El Farol市场模型

§ 4.7 El Farol市场模型动力学

§ 4.8 El Farol市场模型的静态性质：波动率的起源

第五章 具有局域相互作用的金融市场模型

§ 5.1 聚集效应与羊群效应

§ 5.2 信息传递：EZ模型

§ 5.3 解析模型：生成函数方法

§ 5.4 逾渗问题

§ 5.5 格子上的Cont-Bouchaud模型

§ 5.6 变化多端

§ 5.7 修正的EZ模型

§ 5.8 其他微观市场模型

第六章 真实市场中的非零风险

§ 6.1 再论衍生产品

§ 6.2 对冲降低风险

§ 6.3 零风险

§ 6.4 定价和对真实资产变动的对冲

§ 6.5 公式的推广

第七章 确定性动力学、混沌和危机

§ 7.1 与非线性共存

§ 7.2 金融和经济活动中的非线性动力学模型

§ 7.3 金融危机和暴跌

§ 7.4 预测未来：谁将成为亿万富翁

进一步读物

· · · · · (收起)

[金融物理学](#) [下载链接1](#)

标签

金融

物理

经济物理学

经济学

数学

投资

金融物理学

金融物理

评论

看过，没懂。。。

北大信科金融信息工程教材，泛泛而谈不如伊林斯基的书

玄学……

还没看完，但可以肯定这是一个没炒过股的人做的翻译，竟然把做市商翻译成庄家，把二级市场翻译成次级市场。也是醉了

这是我看到过的最差的书之一，过时，陈旧，翻译出现一些低级错误。所以给其以极其负面的评价。不建议阅读。

[金融物理学 下载链接1](#)

书评

[金融物理学 下载链接1](#)