

<<金融时间序列分析>>

图书基本信息

书名：<<金融时间序列分析>>

13位ISBN编号：9787302164081

10位ISBN编号：7302164088

出版时间：2008-1

出版时间：清华大学

作者：张世英

页数：258

字数：331000

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>

<<金融时间序列分析>>

内容概要

金融时间序列分析是一门新的金融统计学课程，汇总了时间序列在金融经济方面应用的理论、办法和应用。

本教材是以作者多年来在金融时间序列方面的科研和教学为基础编写的。

该书体现了较强的理论深度和学术前沿性，同时针对我国金融市场实际进行了大量实证研究，具有理论和实际指导意义。

在长期的教学和相关研究中，我们汇集了大量中国金融市场时间序列多方面的实证分析成果，这将是教材的重要内容。

本书作为财经类或综合类院校的数量经济学、金融学、统计学、数学等专业高年级本科生和棚天领域研究生的教科书，亦可作为数量经济、金融计量、金融工程等领域的研究人员、有关教师、经济和金融工作者的参考书。

<<金融时间序列分析>>

书籍目录

前言 第一章 绪论 第一节 金融时间序列分析概述 第二节 金融时间序列的特点 第二章 时间序列分析 第一节 时间序列与随机过程 第二节 时间序列模型 第三节 非平稳及长记忆时间序列ARFIMA模型 第四节 VAR模型与Granger因果分析 第五节 时间序列分析的状态空间方法第三章 时间序列的单位根过程 第一节 单位根过程及其性质 第二节 单位根过程的检验 第三节 具有单位根的VAR模型第四章 协整理论与建模 第一节 协整与误差校正模型 第二节 协整关系的估计与检验 第三节 基于协整系统的预测 第四节 协整理论的扩展第五章 条件异方差模型 第一节 ARCH模型及其性质 第二节 GARCH模型及其性质 第三节 ARCH类模型扩展 第四节 多元GARCH模型 第五节 金融市场波动性建模与Eviews软件操作第六章 随机波动模型 第一节 SV模型及其统计性质 第二节 SV模型的扩展 第三节 多元SV模型 第四节 SV模型与GARCH模型对金融时间序列刻画能力比较 第五节 风险价值第七章 高频金融时间序列分析 第一节 高频金融时间序列特点与基本问题 第二节 超高频金融时间序列的持续期模型与金融市场微观结构 第三节 金融市场微观结构的实证研究第八章 金融时间序列的小波方法 第一节 离散小波变换与多分辨分析 第二节 基于小波分析的金融波动分析 第三节 多分辨协整及误差校正模型参考文献附表

<<金融时间序列分析>>

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>