

<<金融计量经济学及其软件应用>>

图书基本信息

书名：<<金融计量经济学及其软件应用>>

13位ISBN编号：9787302294825

10位ISBN编号：7302294828

出版时间：2012-9

出版时间：清华大学出版社

作者：朱顺泉

页数：227

字数：358000

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>

## <<金融计量经济学及其软件应用>>

### 内容概要

《金融计量经济学及其软件应用》主要向读者介绍金融计量经济模型及eviews、sas、spss、excel等软件的应用，包括线性回归等一些常用内容和金融计量经济模型的检验及其软件应用等。本书共分14章，主要内容包括：金融计量经济学绪论及其软件应用介绍；参数估计与假设检验；一元线性回归模型及其统计检验；多元线性回归模型及其统计检验；回归模型的多重共线性计量检验与消除；回归模型的异方差计量检验与消除；回归模型的自相关计量检验与消除；滞后变量、虚拟变量设置及其回归分析；联立方程模型及其应用；面板数据模型建立及其应用；金融数据的单位根检验与葛兰杰因果检验及其应用；金融数据的协整检验及其应用；garch模型在金融数据分析中的应用；金融计量经济模型及其应用。

《金融计量经济学及其软件应用》融理论与软件应用等内容于一体，实验性强，内容充实，通俗易懂，可用作大中专院校各类学生学习金融计量经济学等课程的教材或参考书，也可供从事计量经济分析方法的经济管理人员参考，对于从事金融、财务、会计实证研究的读者，本书也是一部良好的教材和参考书。

## 书籍目录

## 第1章 金融计量经济学绪论及其软件应用介绍

## 1.1 金融计量经济学的含义及建模步骤

## 1.1.1 计量经济学与金融计量经济学的含义

## 1.1.2 金融计量经济学的建模过程

## 1.1.3 金融计量经济模型中的数据

## 1.2 金融计量经济学软件简介

## 1.2.1 eviews软件简介

## 1.2.2 sas软件简介

## 1.2.3 spss软件简介

## 1.2.4 matlab软件简介

## 1.3 金融计量经济学软件eviews的使用

## 1.3.1 启动软件包

## 1.3.2 创建工作文件

## 1.3.3 输入和编辑数据

## 1.3.4 查看组内序列的数据特征

## 1.3.5 回归分析——估计消费函数

## 1.3.6 单方程预测

## 1.3.7 邹氏转折点检验

## 1.3.8 两阶段最小二乘法

## 习题

## 第2章 参数估计与假设检验

## 2.1 常用的随机变量分布

## 2.1.1 正态分布

## 2.1.2 分布

## 2.1.3 t分布

## 2.1.4 f分布

## 2.2 区间估计

## 2.2.1 总体均值的区间估计

## 2.2.2 总体方差的区间估计

## 2.3 假设检验

## 2.3.1 方差已知时对一个正态总体均值的z检验

## 2.3.2 方差未知时对一个正态总体均值的t检验

## 2.3.3 一个正态总体方差的检验

## 2.3.4 两个独立正态总体均值的t检验

## 2.3.5 成对样本试验的均值t检验

## 2.3.6 两个正态总体方差的检验(f检验)

## 习题

## 第3章 一元线性回归模型及其统计检验

## 3.1 一元线性回归模型

## 3.1.1 理论回归方程

## 3.1.2 估计回归方程

## 3.2 一元线性回归方程模型的统计检验

## 3.3 一元线性回归模型预测的置信区间

## 3.4 用sas程序建立一元线性回归方程模型

## 习题

## <<金融计量经济学及其软件应用>>

### 第4章 多元线性回归模型及其统计检验

- 4.1 多元线性回归模型假设
- 4.2 多元线性回归模型的矩阵解法
- 4.3 多元线性回归模型的统计检验
- 4.4 用excel建立多元线性回归方程及其统计检验
- 4.5 用sas程序建立多元线性回归模型

#### 习题

### 第5章 回归模型的多重共线性计量检验与消除

- 5.1 多重共线性的概念
- 5.2 多重共线性的后果
- 5.3 产生多重共线性的原因
- 5.4 多重共线性的识别和检验
- 5.5 消除多重共线性的方法
- 5.6 多重共线性消除的eviews应用
- 5.7 多重共线性检验的sas程序应用
- 5.8 多重共线性的spss应用

#### 习题

### 第6章 回归模型的异方差计量检验与消除

- 6.1 异方差的概念
- 6.2 异方差产生的原因
- 6.3 异方差的后果
- 6.4 异方差的识别和检验
- 6.5 消除异方差的方法
- 6.6 异方差的eviews应用
- 6.7 异方差的sas程序应用
- 6.8 异方差的spss应用

#### 习题

### 第7章 回归模型的自相关计量检验与消除

- 7.1 自相关的概念
- 7.2 产生自相关的原因
- 7.3 自相关的后果
- 7.4 自相关的识别和检验
- 7.5 自相关的处理方法
- 7.6 序列相关性的eviews应用
- 7.7 序列相关性的sas程序应用
- 7.8 序列相关性的spss应用

#### 习题

### 第8章 滞后变量、虚拟变量设置及其回归分析

- 8.1 滞后变量
- 8.2 虚拟变量的相关概念
- 8.3 虚拟变量的回归分析

#### 习题

### 第9章 联立方程模型及其应用

- 9.1 联立方程模型的概念
- 9.2 联立方程模型分类
- 9.3 联立方程模型的识别
- 9.4 联立方程模型的估计方法

<<金融计量经济学及其软件应用>>

9.5 联立方程模型案例分析的eviews应用

习题

第10章 面板数据模型的建立及其应用

10.1 面板数据模型

10.2 面板数据库文件的建立

10.3 面板数据模型建立与估计

习题

第11章 金融数据的单位根检验与葛兰杰因果检验及其应用

11.1 时间序列的平稳性检验——单位根检验

11.1.1 adf检验

11.1.2 phillips-perron(pp)检验

11.1.3 单位根检验的实现

11.2 葛兰杰因果检验

11.2.1 葛兰杰因果检验的定义

11.2.2 检验模型

11.2.3 f 检验

11.2.4 实例分析

习题

第12章 金融数据的协整检验及其应用

12.1 协整的概念

12.2 协整检验

12.3 案例分析

12.4 我国资本市场的单位根检验、协整检验和因果检验

习题

第13章 garch模型在金融数据分析中的应用

13.1 garch模型的基本概念

13.2 沪深股市收益率的波动性研究

13.3 股市收益波动的非对称性研究

13.4 沪深股市波动的溢出效应研究

13.5 基于garch模型的上市公司违约概率预测及应用

13.5.1 kmv模型的基本思路

13.5.2 参数设置

13.5.3 应用研究

13.5.4 结论

习题

第14章 金融计量经济模型及其应用

14.1 资本资产定价模型capm的实证模型

14.2 上海股票市场资本资产定价模型的实证检验

14.2.1 资本资产定价模型的形式

14.2.2 capm在国内外的检验

14.2.3 数据的采集与处理

14.2.4 标准形式capm的检验

14.2.5 结论

习题

附录a

附录b

参考文献



## <<金融计量经济学及其软件应用>>

### 编辑推荐

《高等院校财政金融专业应用型教材：金融计量经济学及其软件应用》特点：  
前瞻性 紧跟财政金融专业教学改革步伐，将一些较前沿的课程加入教材建设  
专业性 紧密围绕财政金融专业核心课程，针对性更强，更能体现专业性  
实用性 学生在学完整套教材后，能够具备较强的财政金融业实践能力

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>