

<<金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学>>

13位ISBN编号：9787503745546

10位ISBN编号：7503745541

出版时间：2004-12

出版时间：中国统计出版社

作者：周爱民

页数：478

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>

## <<金融计量学>>

### 内容概要

《金融计量学：经济新学科讲义》的深浅程度介于中级经济计量学与高级经济计量学之间，其先修课程应该包括：中级以上的宏观经济学、银行货币学、证券投资分析或投资学，还有一些基本的数学课程，例如微积分、线性代数、概率统计等。

《金融计量学：经济新学科讲义》本来也想稍微介绍一些20世纪80年代已来的最新研究成果，但囿于篇幅，只能先介绍一些基础性的东西。

但愿能起到抛砖引玉的作用，使读者占开卷有益之先。

## <<金融计量学>>

### 作者简介

周爱民，1961年3月生。分别于1983年、1986年在南开大学数学系获得理学学士与硕士学位，1989年在南开大学国际经济研究所获得经济学博士学位。

2001年美国堪萨斯大学经济系访问学者，现为南开大学金融学系副教授。

研究方向：金融工程及计量经济学。

先后为博士生开设过：高级微观经济学，高级计量经济学，高级宏观经济学，金融经济学和现代金融理论导读等课程。为硕士生开设过：证券投资分析，金融工程，中级微观经济学，计量经济学等课程。

曾经出版专著6部、译著4部；论文几十篇（其中核心刊物论文15篇）；参加科研课题10余项（国家级课题2项、省部级课题5项）。

多次获国家级和省级科研奖。

## &lt;&lt;金融计量学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 金融计量学与经济计量学第一节 经济计量学的创始人第二节 经济计量学的系统论述者和先驱  
 第三节 1970年以前的经济计量学第四节 1970年以后的经济计量学第五节 经济计量学与金融学的交叉  
 阅读材料一：概率分布之间的关系第二章 一元线性回归模型第一节 引言第二节 一元线性回归模型的参数估计  
 第三节 回归参数估计值的特性第四节 回归模型的假设检验第五节 模型预测与置信区间阅读材料二：模型总体的差异性检验  
 第三章 股市有效性——理论与实证第一节 有效市场假定EMI-1{第二节 随机的就是不可预测的吗?第三节 股市指数的动态自回归  
 第四节 对自回归模型残差的分布检验阅读材料三：随机游程统计量检验EMI-I第四章 多元线性回归模型第一节 多元线性回归模型的参数估计  
 第二节 多元线性回归参数估计值的特性第三节 多元线性回归模型的假设检验第四节 多元线性回归模型的预测  
 阅读材料四：证券投资的系统风险度量第五章 多元线性回归模型的应用第一节 股市有效性的进一步讨论  
 第二节 动态过拟合F统计量检验股市有效性第三节 理性股市的“大道定理”第四节 理性股市的动态模拟及性质  
 阅读材料五：2003年不同板块的股票定价模型第六章 相关性与滞后分布模型的讨论第一节 简单相关系数  
 第二节 偏相关系数与复相关系数第三节 相关比和相关指数第四节 基尼系数与等级相关比  
 第五节 滞后分布模型与过度拟合第六节 滞后分布模型的估计与变换阅读材料六：基尼系数度量市盈率的差异  
 第七章 多重共线性的讨论第一节 一般性讨论第二节 多重共线性可能产生的后果第三节 多重共线性的检验方法  
 第四节 多重共线性的修正方法阅读材料七：逐步回归法的实例第八章 异方差性的讨论第一节 随机误差项的异方差性  
 第二节 异方差性可能产生的后果第三节 异方差性的检验方法第四节 异方差性的修正方法  
 阅读材料八：最小描述长度原理检验EMH 第九章 序列相关性的讨论第一节 序列相关的性质  
 第二节 序列相关性可能产生的后果第三节 序列相关性的检验方法第四节 异方差性的修正方法  
 阅读材料九：上证指数一阶自回归的序列相关检验第十章 联立方程组的识别第一节 联立方程组的变量与模型形式  
 第二节 联立方程组的识别与识别约束第三节 结构式模型的识别条件第四节 简约式模型的识别条件  
 阅读材料十：联立方程组的实际估计第十一章 联立方程组的估计第一节 关于联立方程组估计的讨论  
 第二节 工具变量法与间接最小二乘法第三节 两阶段最小二乘法第四节 三阶段最小二乘法  
 第五节 最大似然估计法第六节 是一类估计法阅读材料十一：关于矩阵与向量的求导法则  
 第十二章 微观结构的价格泡沫度量第一节 价格泡沫的理论含义第二节 股市价格泡沫的短期性与应对策略  
 第三节 经典的价格泡沫检验方法第四节 股市价格泡沫检验方法进一步讨论  
 阅读材料十二：风险价值量评估指标的新发展第十三章 协整理论与条件异方差模型第一节 协整理论的诞生与发展  
 第二节 单整性及其检验第三节 协整理论第四节 向量的协整与误差修正模型  
 阅读材料十三：条件异方差模型附表1：标准正态分布临界值附表2：z分布临界值附表3：x分布临界值附表41：5%置信度下的F分布临界值  
 附表42：1%置信度下的F分布临界值附表51：5%置信度下的Dw临界值附表52：1%置信度下的DW临界值  
 附表6：冯诺曼比临界值附表71：DF统计量的临界值附表72：ADF丁卢-1统计量的临界值

#### 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>