

<<金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学>>

13位ISBN编号：9787509529621

10位ISBN编号：750952962X

出版时间：2011-7

出版时间：中国财政经济出版社

作者：姜近勇,潘冠中

页数：310

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

由姜近勇和潘冠中编著的《金融计量学》系统介绍了金融计量学的基本方法和常用工具(有些内容是作者的原创性成果),既反映了该领域教学与研究的最新进展,又十分贴近中国金融市场的实际,填补了国内同类著述的空白,适合于金融领域的学生、教师、学者和金融业界人士作为教材和参考书。

## <<金融计量学>>

### 作者简介

于1995年获得西安大略大学经济学博士学位。

主要研究领域包括资本市场的有效性、利率模型、期权定价、波动率的估计和预测，以及基金业绩评估等。

在诸如Journal

of Financial Economics, Review of Financial Studies, Journal of Financial and Quantitative Analysis, Journal of Econometrics, Journal of Business and Economic Statistics, Journal of Financial Econometrics, Journal of Computational Finance, Econometric Theory, and Journal of Derivatives等学术期刊发表30多篇论文。

于2005年获得上海财经大学金融学博士学位，主要研究领域包括资本市场的有效性、利率模型、期权定价、货币政策与金融市场等。

在《数量经济与技术经济研究》、《财经研究》等学术期刊上发表6篇论文。

主要讲授本科生水平到研究生水平资产定价领域的课程，如金融经济学、投资学、金融工程、风险管理和金融实证方法等。

## 书籍目录

## 第一部分 离散时间模型

## 第一章 收益率的计算、常用数据库及统计软件

## 1.1 收益率的计算

## 1.2 常用金融数据库

## 1.3 常用统计软件

## 第二章 资产定价模型的时间序列估计与检验

## 2.1 资本资产定价模型

## 2.2 capm的估计与检验

## 2.3 实证例子

## 2.4 多因子模型的估计与检验

## 第三章 资产定价模型的横截面估计与检验

## 3.1 capm的横截面含义

## 3.2 排序分析

## 3.3 fama-macbeth回归

## 第四章 面板数据模型与方差估计

## 4.1 面板数据模型

## 4.2 混合回归与fama-macbeth回归

## 4.3 方差估计

## 第五章 随机游走检验

## 5.1 随机游走的设定

## 5.2 随机游走的统计检验

## 5.3 随机游走的经济检验

## 5.4 随机游走检验与有效市场假说

## 第六章 事件研究方法

## 6.1 事件研究的步骤

## 6.2 测定与分析超常收益率

## 6.3 超常收益率的加总

## 6.4 实证例子

## 第七章 arch / garch模型

## 7.1 条件波动率与资产收益率模型

7.2  $\alpha_2$ 的设定7.3  $\alpha_1$ 的设定

## 7.4 模型的估计

## 7.5 实证例子

## 第八章 随机波动率模型

## 8.1 随机波动率模型的设定

## 8.2 sv模型的矩条件

## 8.3 sv模型的广义矩(gmm)估计

## 8.4 其他估计方法

## 第二部分 连续时间模型

## 第九章 由布朗运动和泊松过程驱动的随机过程

## 9.1 布朗运动

## 9.2 随机微分方程

## 9.3 伊藤积分与伊藤引理

## 9.4 多维布朗运动及伊藤引理

## &lt;&lt;金融计量学&gt;&gt;

9.5 模拟扩散过程

9.6 跳跃—扩散过程

9.7 模拟跳跃—扩散过程

第十章 金融中常用连续时间模型的统计性质

10.1 单因子扩散模型

10.2 多因子扩散模型

10.3 跳跃—扩散模型

第十一章 连续时间模型的参数估计方法

11.1 累积量匹配、矩方法和广义矩方法

11.2 极大似然估计

11.3 拟极大似然估计与近似极大似然估计

第十二章 利率模型的半参数与非参数估计方法

12.1 平稳扩散过程的重要性质

12.2 密度函数的核估计与条件期望的n-w估计

12.3 扩散模型的半参数估计方法

12.4 扩散模型的非参数估计方法

第十三章 连续时间模型的特征函数估计方法

13.1 特征函数的定义及基本性质

13.2 独立同分布(iid)情形的ecf估计

13.3 平稳弱相依情形的ecf估计

第十四章 高频数据分析

14.1 二次变差与已实现方差

14.2 已实现幂变差、双幂变差与多幂变差

14.3 市场微观结构噪声的影响

14.4 跳跃检验

参考文献

索引

<<金融计量学>>

媒体关注与评论

“作者对该领域深刻而富于原创性的思考，对连续过程推断方法的细致解读，以及对中国资本市场的大量实证分析，都使得本书在同类著作中别具特色，也使其值得所有那些关注近十几年来金融计量理论发展的学者或研究生参考。

” --王明进教授.北京大学光华管理学院金融风险管理中心主任、博士生导师 “本书系统介绍了金融计量学的基本方法和常用工具（有些内容是作者的原创性成果），既反映了该领域教学与研究的最新进展，又十分贴近中国金融市场的实际，填补了国内同类著述的空白，适合于金融领域的学生、教师、学者和金融业界人士作为教材和参考书。

” --陈启宏教授，上海财经大学“金融数学与金融工程”博士生导师 “本书覆盖了金融计量学的主要内容，具有清晰的框架结构，并且体现了目前国际最前沿的金融计量学教学和研究进展

。其中很多内容都是理解金融学最基本的方法和工具，但是现有国内教材鲜有涉及，对于希望掌握最前沿金融计量方法的学生和学者，是不可或缺的一本教材和参考书。

--郑撮龙教授.国务院学科评议组成员。

闽江学者特聘教授。

厦门大学金融系博士生导师

“姜近勇教授是海外著名的金融学者，在金融计量领域作出了许多原创性的贡献。

由他领衔的《金融计量学》一书深具权威性和前沿性.其中很多内容在现有的国外同类教材中甚至也不多见。

我向国内对金融学感兴趣的读者推荐本书，并期待英文版的面世。” --Professor Charles Cao Smeal

Chair Professor of Finance , Department of Finance , --Smeal College of Business , Pennsylvania State University

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>