

<<Excel与金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<Excel与金融计量学>>

13位ISBN编号：9787561542323

10位ISBN编号：7561542321

出版时间：2012-4

出版时间：厦门大学出版社

作者：周爱民

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>

<<Excel与金融计量学>>

内容概要

本书主要内容包括：线性回归分析、序列相关的Excel检验、异方差、多重共线性、虚拟变量模型、联立方程组模型、时间序列分析等。

<<Excel与金融计量学>>

作者简介

周爱民，经济学博士，南开大学经济学院教授，博士生导师，研究方向：金融工程学，计量经济学。著有《证券投资分析方法研究》《股市有效性、泡沫与预警》《高级宏观经济学》《金融工程学》《证券投资学》《金融计量学》等，主编或合著《EXCEL与金融工程学》《EXCEL与期权定价》等多种专著教材，发表学术论文70余篇。

书籍目录

第一章 线性回归分析 第一节 线性回归概述 一、基本定义 二、模型假设条件 第二节 模型参数估计 一、一元线性回归模型参数估计 二、多元线性回归模型参数估计 第三节 线性回归模型的常规检验 一、F检验 二、t检验及置信区间 三、拟合优度检验第二章 序列相关的Excel检验 第一节 序列相关及其来源后果 一、序列相关的含义 二、序列相关的来源、后果 第二节 序列相关的检验 一、图示法 二、DW检验法 三、LM检验法 第三节 序列相关的修正方法 一、在p已知的情形下——广义最小二乘法 二、广义最小二乘法克服序列相关第三章 异方差 第一节 异方差的含义、来源及影响 一、异方差的含义及表现 二、异方差的来源 三、异方差的影响 第二节 异方差的检验 一、图示检验法 二、戈德菲尔德—匡特(Goldfeld—Quandt)检验 三、怀特(White)检验法 第三节 异方差的修正方法 一、取对数法 二、加权最小二乘法第四章 多重共线性 第一节 多重共线性的来源及其后果 一、多重共线性的来源 二、多重共线性产生的后果 第二节 多重共线性的检验方法 一、实证检验 第三节 多重共线性的修正方法 一、理论方法介绍 二、实际操作第五章 虚拟变量模型 第一节 虚拟变量的设立 一、虚拟变量的定义 二、虚拟变量的注意事项 三、虚拟变量的例子 第二节 用虚拟变量作季节分析 第三节 季节趋势的消除和季节指数的计算 一、移动平均趋势剔除法 二、季节变动的调整 第四节 含虚拟变量的回归分析与方差分析的关系 一、单因素方差分析 二、双因素方差分析 三、含虚拟变量的回归分析与方差分析的关系第六章 联立方程组模型 第一节 联立方程组模型基本概念 一、什么是联立方程组模型 二、什么是内生变量和外生变量 三、什么是联立方程组的结构式与简化式 第二节 联立方程组模型的识别 一、什么联立方程组模型的识别 二、识别条件 第三节 联立方程组模型的估计 一、估计方法 二、间接最小二乘法 三、两阶段最小二乘法 第四节 Excel估计联立方程组模型的应用实例 一、股票收益率与债券收益率之间关系的联立方程组模型 二、货币政策与股票市场间相互关系的联立方程组模型第七章 时间序列分析 第一节 时间序列及时间序列分析简介 一、时间序列 二、时间序列分析 第二节 时间序列的平稳性 一、时间序列的平稳性 二、时间序列的实例 第三节 时间序列的伪回归现象 第四节 时间序列数据的单位根检验 第五节 时间序列的趋势和季节调整 第六节 时间序列的预测 一、趋势预测 二、ARMA模型预测第八章 协整理论及其应用 第一节 协整理论的概念 第二节 时间序列的平稳性检验 一、理论基础 二、实证检验 第三节 协整性检验及误差修正模型(ECM) 一、协整回归 二、协整检验 三、建立单一方程的误差修正模型(ECM) 第四节 向量自回归模型(VAR) 一、模型形式 二、实际操作 第五节 格兰杰因果性检验 一、理论介绍 二、实际操作第九章 面板数据分析 第一节 面板数据简介 一、面板数据及其特点 二、面板数据模型 三、注意事项 第二节 变系数模型 一、模型简介 二、数据处理 三、建立模型 第三节 混合模型与个体固定效应模型 一、数据处理 二、混合模型 三、个体固定效应模型 四、模型选取——F检验 第四节 双因素误差回归模型 一、数据处理 二、混合模型 三、个体时间双固定效应模型 四、模型选取——F检验第十章 ARCH模型与GARCH模型 第一节 金融时间序列的异方差 一、异方差数据的特征 二、Excel中折线图的画法 三、加载分析工具库 四、直方图的画法 第二节 ARCH模型的参数估计与检验 一、ARCH模型的定义 二、ARCH模型的极大似然估计 三、参数估计的具体步骤 四、关于GARCH模型的检验 第三节 GARCH模型的参数估计与检验 一、GARCH模型的定义 二、GARCH模型的极大似然估计 三、关于GARCH模型的检验第十一章 主成分分析及因子分析的Excel实现 第一节 主成分分析的基本思想与模型 一、主成分分析的基本思想 二、主成分分析的几何意义 三、主成分分析的数学模型 四、主成分分析的数学导出 第二节 主成分分析在Excel中的实现 一、主成分分析在Excel中的操作步骤 二、主成分分析具体输出结果 三、分析结论 第三节 因子分析及其在Excel中的实现 一、因子分析的基本思想 二、因子分析与主成分分析的比较 三、因子分析的数学模型 四、因子分析的基本步骤 五、因子分析的Excel实现第十二章 一些检验方法简介 第一节 股市有效性的动态游程统计量检验 一、理论简介 二、实证检验 三、EMH检验的横向比较 第二节 股市有效性的动态MDL检验 一、理论简介 二、实证检验及比较 第三节 股市价格泡沫的分布检验法 一、理论简介 二、分布检验法 三、实证检验与比较 第四节 结构突变序列的IT检验法 一、理论简介 二、实证检验附录Excel2007操作简介参考文献

<<Excel与金融计量学>>

编辑推荐

周爱民等编著的《Excel与金融计量学》与《Excel与金融工程学》《Excel与期权定价》都是作者这几年开设的实验课教材，是南开大学金融学系系列实验教材中的一本。本书共十二章节，内容包括线性回归分析、序列相关的Excel检验、异方差、多重共线性、虚拟变量模型、联立方程组模型、时间序列分析等。

<<Excel与金融计量学>>

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>