

<<金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学>>

13位ISBN编号：9787565407314

10位ISBN编号：7565407313

出版时间：2012-5

出版时间：东北财经大学出版社

作者：斯维特洛扎·T·维特夫, 史蒂芬·米特尼克, 弗兰克·J·法伯兹, 塞尔吉奥·M·福卡尔迪, 特奥·亚西克

页数：385

字数：509000

译者：曲春青

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(从初级到高级建模技术)》一书,是金融计量学研究领域的权威性著作。该书重点介绍了回归分析、单变量自回归移动平均模型、向量自回归过程、协整过程、主成分分析、因子分析、稳定过程以及存在厚尾误差的自回归移动平均模型和GARCH模型等多种模型和方法。该书的内容由浅入深,基本涵盖了现代金融计量学领域的大部分方法和内容。书中对金融计量学方法的介绍,既有详细的基础知识说明,又有实际案例应用的阐述。尤其是通过金融市场中的真实数据进行的举例说明,为读者展示了如何运用金融计量学方法对现实金融问题进行分析研究。因此,该书可以作为经济、金融专业的本科高年级学生和研究生学习金融计量学的教材,也可以作为金融实务领域从业人员学习和使用金融计量学方法的参考用书。

## &lt;&lt;金融计量学&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第1章 金融计量学——范畴与方法

- 1.1 数据生成过程
- 1.2 金融计量学建模步骤
- 1.3 模型的时间跨度
- 1.4 模型的应用

附录：投资管理过程

本章概念(按照出现先后排序)

## 第2章 概率论与统计学知识回顾

- 2.1 概率的概念
- 2.2 估计的原则
- 2.3 贝叶斯建模

附录A：信息结构

附录B：滤链

本章概念(按照出现先后排序)

## 第3章 回归分析：理论和估计

- 3.1 相关关系的概念
- 3.2 回归和线性模型
- 3.3 线性回归的估计
- 3.4 回归的抽样分布
- 3.5 回归模型解释效力的确定
- 3.6 回归分析在金融中的应用
- 3.7 逐步回归
- 3.8 残差非正态性和残差自相关
- 3.9 回归分析方法中的误区

本章概念(按照出现先后排序)

## 第4章 回归分析专题

- 4.1 回归模型中的分类变量和虚拟变量
- 4.2 约束最小二乘
- 4.3 矩估计方法及其一般化

本章概念(按照出现先后排序)

## 第5章 回归分析在金融领域中的应用

- 5.1 回归分析在投资管理过程中的应用
- 5.2 强式定价有效的一个检验
- 5.3 CAPM的检验
- 5.4 利用CAPM评价管理人业绩——詹森指标
- 5.5 多因子模型的证明
- 5.6 标准的选择：夏普标准
- 5.7 基于收益率的对冲基金风格分析
- 5.8 对冲基金的存续期
- 5.9 回归分析在债券组合管理中的应用

本章概念(按照出现先后排序)

## 第6章 单变量时间序列建模

- 6.1 差分方程
- 6.2 术语和定义
- 6.3 ARMA过程的平稳性和可逆性

## &lt;&lt;金融计量学&gt;&gt;

6.4 线性过程

6.5 识别工具

本章概念(按照出现先后排序)

第7章 ARIMA模型的建模和预测方法

7.1 B—J过程概述

7.2 差分次数的识别

7.3 滞后阶数的识别

7.4 模型的估计

7.5 诊断检验

7.6 预测

本章概念(按照出现先后排序)

第8章 自回归条件异方差模型

8.1 ARCH过程

8.2 GARCH过程

8.3 GARCH模型的估计

8.4 平稳ARMA—GARCH模型

8.5 拉格朗日乘数检验

8.6 GARCH模型的变形

8.7 GARCH模型预测

8.8 多元GARCH结构

附录：GARCH(1, 1)模型的性质分析

本章概念(按照出现先后排序)

第9章 向量自回归模型

9.1 VAR模型的定义

9.2 平稳自回归分布滞后模型

9.3 向量自回归移动平均模型

9.4 VAR模型的预测

附录：特征向量与特征值

本章概念(按照出现先后排序)

第10章 向量自回归模型

10.1 稳定VAR模型的估计

10.2 滞后阶数的判断

10.3 残差自相关及其分布的性质

10.4 VAR模型举例

本章概念(按照出现先后排序)

第11章 协整与状态空间模型

11.1 协整

11.2 误差修正模型

11.3 非平稳VAR模型估计的理论和方法

11.4 状态空间模型

本章概念(按照出现先后排序)

第12章 稳健估计

12.1 稳健统计

12.2 回归的稳健估计量

12.3 协方差与相关系数矩阵的稳健估计

12.4 应用

本章概念(按照出现先后排序)

<<金融计量学>>

第13章 主成分分析和因子分析

- 13.1 因子模型
- 13.2 主成分分析
- 13.3 因子分析
- 13.4 债券组合管理中的PCA应用
- 13.5 PCA与因子分析比较

本章概念(按照出现先后排序)

第14章 金融计量学中的厚尾和稳定分布

- 14.1 稳定分布的定义与基本性质
- 14.2 稳定分布的性质
- 14.3 稳定分布的参数估计
- 14.4 在德国股票数据分析中的应用

附录：概率分布的比较

本章概念(按照出现先后排序)

第15章 具有无限方差新息的ARMA和ARCH模型

- 15.1 具有无限方差的自回归过程
- 15.2 稳定GARCH模型
- 15.3 稳定GARCH模型的估计
- 15.4 条件密度的预测

本章概念(按照出现先后排序)

附录 20只股票的月度收益率(2000年12月---2005年11月)

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>