

<<金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学>>

13位ISBN编号：9787810984171

10位ISBN编号：7810984179

出版时间：2005-8

出版时间：上海财经大学出版社

作者：邹平

页数：256

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，是计量经济学的一个重要分支，主要是研究如何将计量经济学的基本原理和方法运用于金融领域，针对金融数据的特殊性，构造相应模型，以便实证检验金融理论和假设或者提供经济金融预测。

金融学的研究早已走上定量分析的道路已经是一个不争的事实，金融计量学也成为金融学的一个重要的学习内容。

本书是作者通过多年在高校讲授金融计量学，结合教学体会和心得而成。

国内类似的书籍已经不少，本书的特色在于强调对实证能力的训练。

在保证理论介绍和阐述的完整性的前提下，通过对Eviews和Microfit两个著名计量软件操作的扼要讲解，借助于每章的案例和数据，注重向读者介绍实证分析的具体做法包括实证性文章的写作，希望对经济类金融类读者定量分析能力的提高有所帮助。

<<金融计量学>>

书籍目录

总序前言第一章 金融计量学介绍第一节 金融计量学的含义及建模步骤第二节 金融计量学软件简介第二章 最小二乘法 and 线性回归模型第一节 最小二乘法的基本属性第二节 一元线性回归模型的统计检验第三节 多变量线性回归模型的统计检验第四节 预测第五节 模型选择附录第三章 异方差和自相关第一节 异方差的介绍第二节 异方差的检验第三节 异方差的修正第四节 金融实例分析第五节 自相关的概念和产生原因第六节 自相关的度量与后果第七节 自相关的检验与修正第四章 多重共线性和虚拟变量的应用第一节 多重共线性的概念和后果第二节 多重共线性的检验第三节 多重共线性的修正第四节 金融数据的多重共线性处理——对影响股票价格指数宏观经济因素的实证分析第五节 虚拟变量模型第六节 回归模型的结构稳定性检验——邹氏检验第七节 回归模型的结构稳定性检验——虚拟变量法第八节 实例——虚拟变量在金融数据处理中的作用第五章 时间序列数据的平稳性检验第一节 随机过程和平稳性原理第二节 平稳性检验的具体方法第三节 协整的概念和检验第四节 误差修正模型第五节 因果检验第六节 实例——金融数据的平稳性检验第六章 动态模型.....第七章 联立方程模型的概念和构造第八章 实证性文章的写作附表参考文献

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>