

<<金融计量学实验>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学实验>>

13位ISBN编号：9787811224429

10位ISBN编号：7811224429

出版时间：2008-8

出版时间：东北财经大学出版社

作者：曲春青 主编

页数：141

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>

## <<金融计量学实验>>

### 前言

高等学校的教学原本就包括理论教学与实践教学两个部分。

理论教学的任务主要是传授知识，教学的方法主要是教师讲授和在一定范围内的课堂讨论。

实践教学的任务主要是培养能力，教学的方法主要是在教师的指导下由学生进行各种验证性、设计性实验和各种课程、专业及综合性的社会实践。

高等教育由精英教育演进为大众教育后，在人才培养方面，为实现传授知识、培养能力和提高素质的统一，在注重理论教学的同时，开始赋予实践教学新的使命，并把实践教学推向了一个新的发展阶段。

只有实践教学，才能验证知识，消化并巩固知识；只有实践教学，才能培养动手能力，形成专业素养；只有实践教学，才能启发创新思维，增强创新意识，提升创新能力。

因此，在中国现阶段，无论是以培养应用型人才为主的教学型大学，还是以培养研究型人才为主的研究型大学，都把实践教学作为教学的重要组成部分。

从完整意义上说，实践教学包括实验教学和在教师指导下的社会实践两个部分。

实验教学是以实验室为基地、在封闭或半封闭的条件下进行的实践教学，社会实践是在实习基地、在开放或有条件开放的条件下进行的实践教学。

## <<金融计量学实验>>

### 内容概要

本书的编写分为实验篇和案例篇两个部分。

根据金融计量学的主要教学内容，实验篇选择性地设计了七个实验，包括线性回归模型应用，简单外推模型应用，平滑技术和季节调整，随机时间序列的特征观察，单位根检验、协整与误差修正模型，ARMA模型应用和条件异方差模型应用。

每个实验包括实验目的与要求、实验准备知识、实验数据、实验内容、实验步骤、问题思考和实验总结等要点，对整个实验过程起到了重要的指导作用。

案例篇针对实验篇的七个实验，结合现实的金融计量问题，提供了七个案例，包括招商银行A股B系数估计，香港认可机构港元存款余额简单外推模型预测，我国金融机构财政存款余额平滑和季节调整等

。案例篇的主要作用是辅助每个实验的教学以及为读者提供参考。

本书可以作为本科高年级或研究生阶段金融计量学实验的指导用书，也可以作为实际部门工作者自学金融计量学的参考用书。

本书提供配套的资料光盘，内有实验和案例的数据，以及案例的Eviews工作文件，方便读者学习使用

。

## &lt;&lt;金融计量学实验&gt;&gt;

## 书籍目录

实验篇 实验一 线性回归模型应用	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验二 简单外推模型应用	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验三 平滑技术和季节调整	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验四 随机时间序列的特征观察	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验五 单位根检验、协整与误差修正模型	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验六 ARMA模型应用	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
实验七 条件异方差模型应用	【实验目的与要求】	【实验准备知识】	【实验数据】
【实验内容】	【实验步骤】	【问题思考】	【实验总结】
案例篇 案例一 招商银行A股B系数估计	1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析	3.建立单指数模型
4.小结	案例二 香港认可机构港元存款余额简单外推模型预测	1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析
3.建立简单外推模型	4.模型比较	5.利用对数自回归趋势模型外推一期	6.小结
案例三 我国金融机构财政存款余额平滑和季节调整	1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析	3.简单移动平均平滑
4.季节调整	5.指数平滑	案例四 我国金融机构储蓄存款余额序列的特征观察	1.创建Eviews工作文件 (Workfile)
2.录入数据, 并对序列进行初步分析	3.序列特征的观察	4.小结	案例五 上证A、B股指数协整关系检验及误差修正模型
1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析	3.单位根检验	4.协整检验
5.建立误差修正模型 (ECM)	案例六 美元对欧元汇率ARMA模型应用	1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析
3.ARIMA (p, d, g) 模型阶数识别	4.ARIMA (p, d, g) 模型估计与检验	5.ARIMA (p, d, g) 模型外推预测	案例七 上证A股收益率条件异方差模型应用
1.创建Eviews工作文件 (Workfile)	2.录入数据, 并对序列进行初步分析	3.建立主体模型	4.ARCH效应检验
5.建立条件异方差模型	6.条件异方差模型的预测	主要参考文献	

<<金融计量学实验>>

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>