

《金融市场计量经济学》

图书基本信息

《金融市场计量经济学》

内容概要

新世纪高校金融学教材译丛。在过去的二十多年里，金融市场中使用数量方法出现了意想不到的增长。现在的金融专业人士在组合管理、资产交易、风险管理、财务咨询和证券管理中，运用成熟的统计技术已经成为惯用的手段。这本经典性著作适用于从事金融计量经济学建模的博士研究生、高级工商管理硕士研究生和金融行业的专业人士。本书包含了实证金融的全部范围，包括资产收益的预测、随机游动的假设、证券市场的微观结构、

书籍目录

译者序

序言

1 引言

2 资产收益的可预报性

3 证券市场的微观结构

4 事件研究分析

5 资本资产定价模型

6 多因素定价模型

7 现值关系

8 跨期均衡模型

9 衍生证券定价模型

10 固定收益证券

11 期限结构模型

12 金融数据中的非线性

GMM附录

参考文献

人名对照表

术语对照表

精彩短评

1、翻译有bugs

章节试读

1、《金融市场计量经济学》的笔记-第22页

鞅假设的另一方面就是对所有时序的前置和后滞，不重合的价格变化量之间是不相关的。这也意味着仅仅基于历史价格基础上的对未来价格变化的线性预测是无效的。

.....

事实上，鞅很早被认为是有效资产市场的必要条件。在有效资产市场中，资产的过去价格所含的信息被即刻、充分且永久地反映到资产的现期价格中。如果一个市场是有效的，那么按照资产的历史价格信息进行交易而获利是不可能的。

《金融市场计量经济学》

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:www.tushu000.com