

# 《金融计量学教程》

## 图书基本信息

书名：《金融计量学教程》

13位ISBN编号：9787810983723

10位ISBN编号：7810983725

出版时间：2005-7

出版社：上海财经大学出版社

作者：张雪莹

页数：265

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《金融计量学教程》

## 内容概要

本书是“新世纪高校证券期货专业系列教材”之一，全书以计量技术及工具为主线，穿插对金融市场理论的介绍，通过讲述每个金融理论采用各种计量工具的实证检验方法，将计量技术与金融理论紧密联系。在内容上，介绍了回归模型、时间序列分析等多方面的计量技术，同时基本上涵盖了金融理论与实证的大部分常见专题，并且单独介绍了资产定价与市场效率假说两大金融市场的理论核心，还穿插介绍了对宏观金融理论的实证研究。本书共分为七个章节，文中插入了大量的金融相关理论和实证案例是本书的又一特色，文后还有阅读与思考，方便学生复习巩固。

## 书籍目录

总序前言1 概率论与统计基础1.1 总体、样本及随机变量1.2 随机变量的统计特征1.3 常用的概率分布1.4 假设检验与置信区间2 回归模型及应用2.1 数据和模型2.2 线性回归模型的参数估计和统计检验2.3 不满足古典假设时的计量经济问题2.4 虚拟变量与模型的稳定性问题2.5 联立方程模型2.6 面板数据模型2.7 离散因变量模型3 资产定价模型的实证检验3.1 CAPM实证检验的经典方法3.2 中国股市CAPM实证检验案例3.3 三因素模型实证检验的经典方法3.4 三因素模型在中国股市的实证检验案例4 有效市场假说与事件研究法4.1 有效市场理论的主要内容4.2 有效市场假说的实证检验4.3 事件研究法的过程4.4 事件研究法的应用案例4.5 事件研究法在中国的应用综述5 一元时间序列的分析方法及应用5.1 时间序列分析方法的特点与平稳性的提出5.2 重要的时间序列5.3 时间序列的平稳性检验5.4 一元时间序列分析方法的应用：市场弱式有效假说的检验6 多元时间序列的分析方法与应用6.1 协整的含义及其在这证研究中的应用6.2 协整检验与误差修正模型6.3 向量自回归模型与协整的Johansen检验6.4 Granger因果关系检验7 ARCH模型族与金融时间序列波动特征的研究7.1 ARCH模型族的产生背景7.2 ARCH模型族的分类7.3 ARCH模型族的检验与估计7.4 ARCH模型族在中国的应用附表参考文献

## 精彩短评

1、适合于本科生

# 《金融计量学教程》

## 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](http://www.tushu000.com)