

《基于EViews的金融计量学（经济管理类课程教材·金融系列）》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2011年01月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787300129426

丛书名：经济管理类课程教材·金融系列

内容简介

《基于EViews的金融计量学》深度引入项目教学理念，在每一大部分之前先设计一个金融研究项目，后续相关章节以项目相关问题的展开引导金融计量理论与技术，并以任务驱动型学习方式力求使读者保持学习兴趣，并使读者养成系统研究的习惯。

本书适合作为高等院校金融学专业本科或研究生的金融计量学教材，也可以作为对金融学有兴趣并期望快速掌握信息技术工具来实证分析金融问题的理论工作者和实际工作者的参考书。全书在汪昌云教授的主持下组织编写。

作者简介

汪昌云教授，1982年进入中国人民大学工业经济系学习，1986年获经济学学士学位，1989年获中国人民大学经济学硕士学位，1999年获伦敦大学金融学博士学位。1999-2005年任教于新加坡国立大学商学院。主要研究领域包括金融衍生工具，资产定价，金融风险管理，中国资本市场。自1999年以来，在国际高质量金融学期刊发表论文15篇，其中SSCI论文篇，其金融衍生工具和资产定价等研究在国际学术界有较大影响。汪昌云现任中国人民大学财政金融学院教授，博士生导师；澳门科技大学和对外经济贸易大学兼职教授；中国金融学年会常务理事；《金融学季刊》副主编。

目录

第1章 金融数据分析初步

1.1 金融计量研究的步骤与任务

1.2 金融时间序列

1.3 金融计量软件Eviews介绍

1.4 案例介绍

第2章 平稳时序模型

2.1 自回归模型AR

2.2 移动平均模型MA

2.3 自回归移动平均模型ARMA

2.4 自回归单整移动平均模型ARIMA

2.5 Eviews案例

第3章 非平稳时序模型

3.1 时间趋势模型及去除趋势法

3.2 随机趋势模型及差分法

3.3 单位根检验

3.4 Eviews案例

第4章 ARIMA模型应用案例——通货膨胀预测分析

4.1 利用Eviews进行预测的理论背景

4.2 在Eviews中如何进行预测分析

4.3 利用Eviews进行中国CPI通胀预测的示例

第5章 多维动态模型VAR

5.1 VAR模型介绍

5.2 VAR模型的属性

5.3 VAR模型的估计与相关检验

5.4 格兰杰因果关系

5.5 VAR模型的脉冲响应分析

5.6 VAR模型与方差分解

5.7 Eviews案例

第6章 协整分析

6.1 协整的基本定义

6.2 Engle Granger协整分析方法

6.3 VECM & Johansen协整分析方法

6.4 Eviews案例

第7章 GARCH族模型

7.1 ARCH模型

7.2 GARCH模型

7.3 GARCH模型的其他形式

7.4 案例分析

第8章 资产定价模型与估计

8.1 CAPM理论回顾

8.2 CAPM实证检验方法

8.3 多因素资产定价模型

8.4 资产定价模型的检验与Eviews

第9章 事件研究法

9.1 事件研究概述

9.2 收益率估计

9.3 统计检验

9.4 事件研究法与Eviews

第10章 面板数据回归模型

10.1 横截面和时期自变量

10.2 面板数据模型中的自回归过程

10.3 固定和随机效应

10.4 广义最小二乘法

10.5 工具变量

10.6 稳健协方差系数

10.7 Eviews案例

第11章 三因素资产模型与Eviews：综合案例

11.1 三因素资产定价模型

11.2 三因素模型的实证步骤

11.3 三因素模型实证分析与Eviews

附录1 统计学与矩阵代数回顾

F1.1 概率和统计知识回顾

F1.2 矩阵代数知识回顾

附录2 回归分析

F2.1 回归分析基本模型及假设

F2.2 最小二乘法估计基本模型

F2.3 估计量的精确度和拟合优度

F2.4 假设检验

F2.5 Eviews案例

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)