

《经济计量分析基础》

书籍信息

版次：5

页数：

字数：

印刷时间：2014年01月01日

开本：12k

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787513628303

丛书名：量化投资方法丛书

编辑推荐

量化投资基础知识、计量经济学

内容简介

本书详细系统地讲述了量化投资所需要的数理统计和经济计量基础理论、方法及其内在的逻辑关系；在此基础上，介绍了经济计量软件包Eviews的使用方法；尤其是，最后一章结合国际著名《金融经济学杂志》2001年发表的芝加哥大学商学院TJ.Moskowitz教授、对冲基金AQR资本管理公司的Yao Hua Ooi以及纽约大学商学院Lasse Heje Pederson教授的《时序动量》一文，基于上证指数来详细说明基础的经济计量分析方法在量化投资中的使用。

作者简介

刘振亚教授现为中国人民大学财金学院和英国伯明翰大学教授，博士生导师，摩根大通期货有限公司(JP Morgan Futures)董事，全球*管理期货（CTA）Winton Capital中国最早的合作者。刘振亚教授在金融计量、量化投资、宏观经济等领域有着深入的研究，从1991年以来已出版多本专业著作，并在China Economic Review、《世界经济》等国内外一流杂志发表多篇文章。

目录

第一章 经济计量分析的统计基础

第一节 总体与样本

第二节 总体与样本的桥梁——随机变量

第三节 对总体的描述——随机变量的数字特征

第四节 对样本的描述——样本分布的数字特征

第五节 随机变量的分布——总体和样本的连接点

第六节 通过样本，估计总体（一）——估计量的特征

第七节 通过样本，估计总体（二）——估计量的特征

第八节 通过样本，估计总体（三）——假设检验

第九节 应用实例：最佳持股周期

第二章 数据与模型

第一节 数据、模型和变量

第二节 方程形式

第三节 相关系数第一章 经济计量分析的统计基础 第一节 总体与样本 第二节

总体与样本的桥梁——随机变量 第三节 对总体的描述——随机变量的数字特征 第四节

对样本的描述——样本分布的数字特征 第五节 随机变量的分布——总体和样本的连接点

第六节 通过样本，估计总体（一）——估计量的特征 第七节

通过样本，估计总体（二）——估计量的特征 第八节

通过样本，估计总体（三）——假设检验 第九节 应用实例：最佳持股周期第二章

数据与模型 第一节 数据、模型和变量 第二节 方程形式 第三节 相关系数第三章

最小二乘法：一元线性回归 第一节 拟合直线性质 第二节 拟合优度的评价 第三节

一元线性回归中的计算问题 第四节 应用案例：对资产定价模型（CAPM）的简单检验

第四章 最小二乘法与多因素模型——含多个自变量的最小二乘法 第一节

含两个自变量的最小二乘法 第二节 二元回归最小二乘法又探 第三节

从另一个角度看估计系数 第四节 多重共线性 第五节 一般线性回归第五章

古典线性回归模型 第一节 有关 i 的古典模型假设 第二节 古典假设的一些内涵 第三节

高斯-马尔科夫定理 第四节 高斯-马尔科夫定理再探第六章 正态条件下回归的推论

第一节 问题的引入 第二节 问题的预解决 第三节 派生的内容：自由度 第四节

回归系数的假设检验 第五节 预测 第六节 复习与提高第七章 假设检验 第一节

t检验：对单个参数检验的方法 第二节 F检验的引入 第三节 一般假设检验：F检验 第四节

F检验的附加例子 第五节 调整后的相关系数 第六节 因果关系检验 第七节 复习与提高

第八章 虚拟变量 第一节 运用虚拟变量改变回归直线的截距 第二节

运用虚拟变量改变回归直线的斜率 第三节 运用虚拟变量同时改变回归直线的截距和斜率

第四节 折线回归 第五节 复习与提高第九章 计量经济学软件EViews简介 第一节

关于计算机的一些基本概念 第二节 EViews概述 第三节 工作文件的建立及相关操作

第四节 基本回归模型 第五节 复习与提高第十章 异方差 第一节 异方差概述 第二节

如何发现异方差 第三节 异方差的后沟 第四节 异方差的解决方法第十一章 自相关 第一节

自相关概述 第二节 Durbin-Watson检验 第三节 自相关的处理方法 第四节

自相关误差下的回归过程 第五节 一阶自相关对最小二乘估计量的影响 第六节

对含滞后因变量的序列相关模型的检验 第七节 DW检验的更为深入的结论 第八节

DW显著时的策略第十二章 联系方程模型 第一节 概述 第二节 内生变量和外生变量

第三节 间接最小二乘法 第四节 识别问题 第五节 识别的充要条件 第六节 估计方法

第七节 运用最小二乘法估计联立方程组问题 第八节 复习与提高第十三章

基于时序动量回报率的量化交易策略附表参考书目

[显示全部信息](#)

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)