

<<金融时间序列的经济计量学模型>>

图书基本信息

书名：<<金融时间序列的经济计量学模型>>

13位ISBN编号：9787505827813

10位ISBN编号：7505827812

出版时间：2002-7

出版时间：经济科学出版社

作者：[英] 特伦斯·C. 米尔斯

页数：412

字数：460000

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>

<<金融时间序列的经济计量学模型>>

内容概要

本书是一本理论和实践结合得比较好的著作，从理论到实践，从方法到技巧，数学工作者（首先是统计学家）和经济工作者都可以从本书中学习到很多东西。

经济科学出版社将本书引进并译成中文，对于我国有志于研究现代金融理论与方法的研究人员，以及对于扩大金融数学的影响无疑是一件极为有益且值得称道的工作。

本书也可作为本科高年级学生或研究生学习类似“金融时间序列分析”课程时的一本十分优秀的教学参考书。

<<金融时间序列的经济计量学模型>>

作者简介

特伦斯·米尔斯是拉夫伯勒大学 (Loughborough University) 的经济学教授。
他在沃里克大学 (University of Warwick) 获得博士学位，曾在里兹大学 (University of Leeds) 讲学，并在城市大学商学院 (City University Business School) 和赫尔大学 (University of Hull) 担任教授。
他发表

<<金融时间序列的经济计量学模型>>

书籍目录

从书总序 中文版序言 作者中文版序言 本书简介 第二版序方1、引言2、单变量线性随机模型：基本概念
2.1 随机过程、遍历性和平稳性 2.2 随机差分方程 2.3 ARMA过程 2.4 线性随机过程 2.5 ARMA
模型的建立 2.6 非平稳过程和ARIMA模型 2.7 ARIMA模型的建立 2.8 利用ARIMA模型预测3、单变
量线性随便机模型：深入课题 3.1 确定时间序列的积分次 3.2 分解时间序列：不可风成分模型和信
号提取 3.3 持久性和趋势回归的测量4、单变量非线性随机模型5、拟合收益率分布6、非积他金融时
间序列的回归方法7、积分金融时间序列的回归方法8、积分金融时间序列分析的深入课题

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>