

<<金融计量学>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学>>

13位ISBN编号：9787564208523

10位ISBN编号：756420852X

出版时间：2010-9

出版时间：上海财经大学出版社有限公司

作者：邹平

页数：256

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>

## 内容概要

市场经济是契约经济，是信用经济。

没有信用，市场经济就无法运行。

当今，中国的市场经济建设正面临着非常尴尬的局面，那就是信用危机。

在过去的计划经济体系中几乎不存在市场，也几乎不存在公开的市场信用关系，企业的生产、销售、资金来源等一系列经营活动均出自国家的行政命令；而消费者个人的生活物资匮乏，无论是住房还是日常生活用品都受到政府的调控，个人没有能力、没有意识，也不被鼓励进行贷款消费。

政府制定的集中信用于银行的金融政策，将所有的信用关系都纳入计划的调控，信用资源由政府来分配，信用活动受行政命令的主导。

可以说，在计划经济时期，无论是企业还是个人都不需要关心信用问题。

这是我国市场主体信用意识薄弱的历史根源之一。

## &lt;&lt;金融计量学&gt;&gt;

## 书籍目录

总序再版前言前言第一章 金融计量学介绍 第一节 金融计量学的含义及建模步骤 一、金融计量学的含义 二、金融计量建模的主要步骤 三、金融数据的主要类型、特点和来源 第二节 金融计量学软件简介 一、金融计量学主要软件简介 二、本课程所用软件——Microfit4.0和Eviews3.1 本章小结 本章关键术语 本章思考题 本章练习题第二章 最小二乘法和线性回归模型 第一节 最小二乘法的基本属性 一、有关回归的基本介绍 二、参数的最小二乘估计 三、最小二乘估计量的性质和分布 第二节 一元线性回归模型的统计检验 一、拟合优度检验 二、假设检验 第三节 多变量线性回归模型的统计检验 一、多变量模型的简单介绍 二、拟合优度检验 三、假设检验 第四节 预测 一、预测的概念和类型 二、预测的评价标准 第五节 模型选择 一、“好”模型具有的特性 二、用于预测的模型的选择 附录 本章小结 本章关键术语 本章思考题 本章练习题第三章 异方差和自相关 第一节 异方差的介绍 一、异方差的定义及产生原因 二、异方差的后果 第二节 异方差的检验 一、图示法 二、解析法 第三节 异方差的修正 一、当为已知 二、当为未知 三、模型对数变换法 第四节 金融实例分析 第五节 自相关的概念和产生原因 一、滞后值与自相关的概念 二、自相关产生的原因 第六节 自相关的度量与后果 一、自相关的度量 二、出现自相关的后果 第七节 自相关的检验与修正 一、自相关的检验方法 二、自相关的修正方法 本章小结 本章关键术语 本章思考题第四章 多重共线性和虚拟变量的应用 第一节 多重共线性的概念和后果 一、多重共线性的概念和产生 二、多重共线性的后果 第二节 多重共线性的检验 一、检验多重共线性问题是否严重 二、判断多重共线性的存在范围 三、检验多重共线性的表现形式 第三节 多重共线性的修正 一、删除不必要的变量 二、改变解释变量的形式 三、补充新数据 四、利用先验信息法 第四节 金融数据的多重共线性处理——对影响股票价格指数宏观经济因素的实证分析 第五节 虚拟变量模型 一、虚拟变量的性质和设置原则 二、虚拟变量模型的运用 第六节 回归模型的结构稳定性检验——邹氏检验 一、邹氏检验的过程 二、在Eviews软件中如何进行邹氏检验 第七节 回归模型的结构稳定性检验——虚拟变量法 第八节 实例——虚拟变量在金融数据处理中的作用 一、简单理论回顾 二、实证检验 本章小结 本章关键术语 本章思考题 本章练习题第五章 时间序列数据的平稳性检验 第一节 随机过程和平稳性原理 一、随机过程 二、平稳性原理 三、伪回归现象 第二节 平稳性检验的具体方法 一、单位根检验 二、非平稳性数据的处理 第三节 协整的概念和检验 一、协整的概念和原理 二、协整检验的具体方法 第四节 误差修正模型 第五节 因果检验 一、格兰杰因果检验 二、希姆斯检验 第六节 实例——金融数据的平稳性检验 一、对数据进行平稳性检验 二、协整检验 三、因果检验 四、误差纠正机制ECM 本章小结 本章关键术语 本章思考题

#### 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>