

图书基本信息

书名：<<金融市场计量经济分析（中国版）>>

13位ISBN编号：9787509207420

10位ISBN编号：7509207428

出版时间：2011-6

出版时间：中国市场出版社

作者：田益祥

页数：266

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>

## <<金融市场计量经济分析（中国版）>>

### 内容概要

金融市场计量经济学是现代金融理论与计量经济技术相结合的一门新兴的综合性学科。本书从中国金融市场的实际出发，解释金融市场计量经济学的基本概念和计量经济方法。通过基于中国证券市场真实数据的例子，在常用的分析软件上实现操作。

由田益祥编著的《金融市场计量经济分析》的学习不要求学习者事先修过计量经济学的课程，在教学上为教师提供了很大的灵活性。

对于有余力的学习者，作者也准备了一些较难的数学推导作为选学内容。

本书所有的例子和案例都能在Eviews软件上实现，不仅较好地诠释了理论和现实背景和应用方法，而且让学习者可以自行操作复制，抓住读者的学习兴趣。

在提高理论水平的同时还可以培养分析实际问题的软件操作能力。

《金融市场计量经济分析》适用对象包括金融学、管理学、商学类专业的本科高年级学生或研究生、MBA以及金融市场分析从业人员。

作者简介

田益祥，电子科技大学经济管理学院副院长

## 书籍目录

## 推荐序

## 序言

## 第1章 引言

- § 1.1 金融市场计量经济学简介
- § 1.2 金融市场计量经济模型与数据
- § 1.3 金融市场计量经济建模的过程
- § 1.4 金融市场计量经济分析应用举例
- § 1.5 实证研究的方法体系

## 第2章 金融市场的基本概念

- § 2.1 价格、收益率和复合法
- § 2.2 金融市场的有效假说
- § 2.3 随机游走假说
- § 2.4 金融市场有效性检验

## 第3章 金融市场的事件研究

- § 3.1 事件研究概述
- § 3.2 事件研究法的过程
- § 3.3 事件研究法的应用

## 第4章 资本资产定价模型的估计与检验

- § 4.1 资本资产定价模型回顾
- § 4.2 资本资产定价模型的估计
- § 4.3 资本资产定价模型的检验
- § 4.4 三因素模型估计与检验

## 第5章 金融时间序列基本概念

- § 5.1 金融时间序列基本特征
- § 5.2 金融时间序列变量的相关性
- § 5.3 金融时间序列平稳性
- § 5.4 金融时间序列平稳模型
- § 5.5 金融时间序列模型的识别、估计与预测一

## 第6章 金融市场相关性分析

- § 6.1 金融时间序列平稳性检验
- § 6.2 金融市场的长期关系分析
- § 6.3 金融市场的Granger因果关系

## 第7章 金融市场波动性分析

- § 7.1 金融市场波动性描述
- § 7.2 金融市场波动性模型
- § 7.3 ARCH—M波动模型及应用
- § 7.4 GARCH波动性模型

## 第8章 微观计量经济学与公司财务分析

- § 8.1 微观计量经济学最新进展
- § 8.2 面板数据模型的基本概念
- § 8.3 面板数据模型选择
- § 8.4 面板数据模型的估计
- § 8.5 动态面板数据模型
- § 8.6 公司财务数据模型的建立与估计

## 参考文献

部分思考题的参考答案

编辑推荐

《金融市场计量经济分析》适用对象包括金融学、管理学、商学类专业的本科高年级学生或研究生、MBA以及金融市场分析从业人员。

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>