

<<金融计量学实验>>

图书基本信息

书名：<<金融计量学实验>>

13位ISBN编号：9787811224429

10位ISBN编号：7811224429

出版时间：2008-8

出版时间：东北财经大学出版社

作者：曲春青 主编

页数：141

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>

<<金融计量学实验>>

前言

高等学校的教学原本就包括理论教学与实践教学两个部分。

理论教学的任务主要是传授知识，教学的方法主要是教师讲授和在一定范围内的课堂讨论。

实践教学的任务主要是培养能力，教学的方法主要是在教师的指导下由学生进行各种验证性、设计性实验和各种课程、专业及综合性的社会实践。

高等教育由精英教育演进为大众教育后，在人才培养方面，为实现传授知识、培养能力和提高素质的统一，在注重理论教学的同时，开始赋予实践教学新的使命，并把实践教学推向了一个新的发展阶段。

只有实践教学，才能验证知识，消化并巩固知识；只有实践教学，才能培养动手能力，形成专业素养；只有实践教学，才能启发创新思维，增强创新意识，提升创新能力。

因此，在中国现阶段，无论是以培养应用型人才为主的教学型大学，还是以培养研究型人才为主的研究型大学，都把实践教学作为教学的重要组成部分。

从完整意义上说，实践教学包括实验教学和在教师指导下的社会实践两个部分。

实验教学是以实验室为基地、在封闭或半封闭的条件下进行的实践教学，社会实践是在实习基地、在开放或有条件开放的条件下进行的实践教学。

<<金融计量学实验>>

内容概要

本书的编写分为实验篇和案例篇两个部分。

根据金融计量学的主要教学内容，实验篇选择性地设计了七个实验，包括线性回归模型应用，简单外推模型应用，平滑技术和季节调整，随机时间序列的特征观察，单位根检验、协整与误差修正模型，ARMA模型应用和条件异方差模型应用。

每个实验包括实验目的与要求、实验准备知识、实验数据、实验内容、实验步骤、问题思考和实验总结等要点，对整个实验过程起到了重要的指导作用。

案例篇针对实验篇的七个实验，结合现实的金融计量问题，提供了七个案例，包括招商银行A股B系数估计，香港认可机构港元存款余额简单外推模型预测，我国金融机构财政存款余额平滑和季节调整等

。案例篇的主要作用是辅助每个实验的教学以及为读者提供参考。

本书可以作为本科高年级或研究生阶段金融计量学实验的指导用书，也可以作为实际部门工作者自学金融计量学的参考用书。

本书提供配套的资料光盘，内有实验和案例的数据，以及案例的Eviews工作文件，方便读者学习使用

。

<<金融计量学实验>>

书籍目录

| | | | |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 实验篇 实验一 线性回归模型应用 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验二 简单外推模型应用 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验三 平滑技术和季节调整 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验四 随机时间序列的特征观察 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验五 单位根检验、协整与误差修正模型 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验六 ARMA模型应用 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 实验七 条件异方差模型应用 | 【实验目的与要求】 | 【实验准备知识】 | 【实验数据】 |
| 【实验内容】 | 【实验步骤】 | 【问题思考】 | 【实验总结】 |
| 案例篇 案例一 招商银行A股B系数估计 | 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 | 3.建立单指数模型 |
| 4.小结 | 案例二 香港认可机构港元存款余额简单外推模型预测 | 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 |
| 3.建立简单外推模型 | 4.模型比较 | 5.利用对数自回归趋势模型外推一期 | 6.小结 |
| 案例三 我国金融机构财政存款余额平滑和季节调整 | 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 | 3.简单移动平均平滑 |
| 4.季节调整 | 5.指数平滑 | 案例四 我国金融机构储蓄存款余额序列的特征观察 | 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) |
| 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 | 3.序列特征的观察 | 4.小结 | 案例五 上证A、B股指数协整关系检验及误差修正模型 |
| 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 | 3.单位根检验 | 4.协整检验 |
| 5.建立误差修正模型 (ECM) | 案例六 美元对欧元汇率ARMA模型应用 | 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 |
| 3.ARIMA (p, d, g) 模型阶数识别 | 4.ARIMA (p, d, g) 模型估计与检验 | 5.ARIMA (p, d, g) 模型外推预测 | 案例七 上证A股收益率条件异方差模型应用 |
| 1.创建Eviews工作文件 (Workfile) | 2.录入数据, 并对序列进行初步分析 | 3.建立主体模型 | 4.ARCH效应检验 |
| 5.建立条件异方差模型 | 6.条件异方差模型的预测 | 主要参考文献 | |

<<金融计量学实验>>

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>