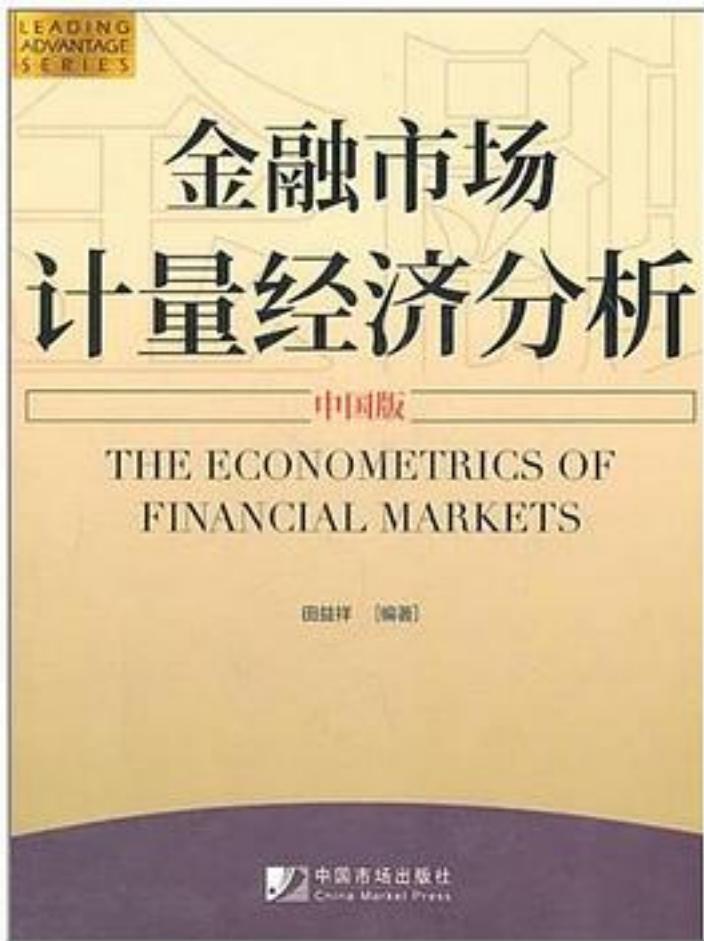


金融市场计量经济分析（中国版）



[金融市场计量经济分析（中国版）下载链接1](#)

著者:田益祥

出版者:

出版时间:2011-6

装帧:

isbn:9787509207420

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。

作者介绍：

田益祥，电子科技大学经济管理学院副院长

目录: 序言

第一章 导言

本章学习目标

§ 1.1 金融市场计量学简介

§ 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

本章思考题

第二章 金融市场的基本概念

本章学习目标

§ 2.1 价格、收益和复合法

§ 2.2 金融市场有效市场假说

§ 2.3 随机游走假说

§ 2.4 金融市场有效性检验

本章Eviews操作练习

本章思考题

第三章 金融市场的事件研究

本章学习目标

§ 3.1 事件研究概述

§ 3.2 事件研究研究过程

§ 3.3 事件研究研究法的应用举例

Eviews操作练习

思考题

第四章 资本资产定价模型的估计与检验

本章学习目标

§ 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 三因素模型的估计与检验

本章Eviews操作练习

本章思考题

第五章 金融时间序列基本概念

本章学习目标

§ 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 金融时间序列模型识别、估计与预测

本章Eviews操作练习

本章思考题

第六章 金融市场的相关性分析

本章学习目标

§ 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因果关系检验

本章Eviews操作练习

本章思考题

第七章 金融市场的波动性分析

本章学习目标

§ 7.1 金融市场波动性描述

§ 7.2 金融市场波动性模型

§ 7.2 ARCH-M波动性模型及应用

§ 7.3 GARCH波动性模型

本章Eviews操作练习

本章思考题

第八章 微观计量经济学与公司财务分析

本章学习目标

§ 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 动态面板数据模型简介

§ 8.6 公司财务数据模型分析

本章Eviews操作练习

本章思考题

参考文献

思考题参考答案

附表

· · · · · (收起)

[金融市场计量经济分析（中国版）](#) [下载链接1](#)

标签

计量

金融

经济

11

评论

很清楚。就是薄了点儿。

[金融市场计量经济分析（中国版）](#) [下载链接1](#)

书评

[金融市场计量经济分析（中国版）](#) [下载链接1](#)