

金融计量学



[金融计量学_下载链接1](#)

著者:姜近勇

出版者:中国财政经济出版社

出版时间:2011-7

装帧:

isbn:9787509529621

由姜近勇和潘冠中编著的《金融计量学》系统介绍了金融计量学的基本方法和常用工具

(有些内容是作者的原创性成果)，既反映了该领域教学与研究的最新进展，又十分贴近中国金融市场的实际，填补了国内同类著述的空白，适合于金融领域的学生、教师、学者和金融业界人士作为教材和参考书。

作者介绍:

于1995年获得西安大略大学经济学博士学位。主要研究领域包括资本市场的有效性、利率模型、期权定价、波动率的估计和预测，以及基金业绩评估等。在诸如Journal of Financial Economics, Review of Financial Studies, Journal of Financial and Quantitative Analysis, Journal of Econometrics, Journal of Business and Economic Statistics, Journal of Financial Econometrics, Journal of Computational Finance, Econometric Theory, and Journal of Derivatives等学术期刊发表30多篇论文。

于2005年获得上海财经大学金融学博士学位，主要研究领域包括资本市场的有效性、利率模型、期权定价、货币政策与金融市场等。在《数量经济技术经济研究》、《财经研究》等学术期刊上发表6篇论文。主要讲授本科生水平到研究生水平资产定价领域的课程，如金融经济学、投资学、金融工程、风险管理和金融实证方法等。

目录: 第一部分 离散时间模型

第一章 收益率的计算、常用数据库及统计软件

1.1 收益率的计算

1.2 常用金融数据库

1.3 常用统计软件

第二章 资产定价模型的时间序列估计与检验

2.1 资本资产定价模型

2.2 capm的估计与检验

2.3 实证例子

2.4 多因子模型的估计与检验

第三章 资产定价模型的横截面估计与检验

3.1 capm的横截面含义

3.2 排序分析

3.3 fama-macbeth回归

第四章 面板数据模型与方差估计

4.1 面板数据模型

4.2 混合回归与fama-macbeth回归

4.3 方差估计

第五章 随机游走检验

5.1 随机游走的设定

5.2 随机游走的统计检验

5.3 随机游走的经济检验

5.4 随机游走检验与有效市场假说

第六章 事件研究方法

6.1 事件研究的步骤

6.2 测定与分析超常收益率

6.3 超常收益率的加总

6.4 实证例子

第七章 arch/garch模型

7.1 条件波动率与资产收益率模型

7.2 α_2 的设定

7.3 ω 的设定

7.4 模型的估计

7.5 实证例子

第八章 随机波动率模型
8.1 随机波动率模型的设定
8.2 sv模型的矩条件
8.3 sv模型的广义矩(gmm)估计
8.4 其他估计方法
第二部分 连续时间模型
第九章 由布朗运动和泊松过程驱动的随机过程
9.1 布朗运动
9.2 随机微分方程
9.3 伊藤积分与伊藤引理
9.4 多维布朗运动及伊藤引理
9.5 模拟扩散过程
9.6 跳跃—扩散过程
9.7 模拟跳跃—扩散过程
第十章 金融中常用连续时间模型的统计性质
10.1 单因子扩散模型
10.2 多因子扩散模型
10.3 跳跃—扩散模型
第十一章 连续时间模型的参数估计方法
11.1 累积量匹配、矩方法和广义矩方法
11.2 极大似然估计
11.3 拟极大似然估计与近似极大似然估计
第十二章 利率模型的半参数与非参数估计方法
12.1 平稳扩散过程的重要性质
12.2 密度函数的核估计与条件期望的n-w估计
12.3 扩散模型的半参数估计方法
12.4 扩散模型的非参数估计方法
第十三章 连续时间模型的特征函数估计方法
13.1 特征函数的定义及基本性质
13.2 独立同分布(iid)情形的ecf估计
13.3 平稳弱相依情形的ecf估计
第十四章 高频数据分析
14.1 二次变差与已实现方差
14.2 已实现幂变差、双幂变差与多幂变差
14.3 市场微观结构噪声的影响
14.4 跳跃检验
参考文献
索引

• • • • • ([收起](#))

[金融计量学_下载链接1](#)

标签

金融

计量经济学

金融计量学

教材

姜近勇

中国

金融统计与计量学

经济

评论

比Campbell那本97年的《The Econometrics of Financial Markets》好读。读得最认真的是每章的实证例子。

材料是2010年潘冠中访问亚利桑那大学和姜近勇合作写的，还算不太老，我查读了一些内容不错，真正有意思的就是结尾那四章非参估计一些新东西。数据都是国内的，这算大陆学者写的中上的入门教材了，当然最近新出了不少金融计量冠名的书，包括一些统计大牛写的外文版出口转内销。///花了几天通读完，收获不是很大，额，似乎和统计的深入没有太大的联系，都是假定读者对一些统计基础了解，比如非参那个最优宽带的小公式一行一笔带过但是wasserman的完全统计学或者非常统计学都给了一章十几页的篇幅详细解释推导和拓展。这本金融计量似乎和利率模型理论推导紧密结合，和什么时间序列啦，garch，协整var等等没什么介绍。这本利率模型的推导都给出了详细的公式，似乎是本不错的参考，但如果真的细读肯定读brigo，这本太浅。

超喜欢的一本书。的确是少见的优秀中文计量金融专著。思路非常清楚，表述清晰，有原创性。帮助我搞定了资产定价的毕业论文哈哈

感觉是 现有金融计量方面 中文书 里
最好的一本（至少在2019年之前），虽然里面还有些typo，
作者提供的个人主页也失效了。希望可以再版，尤其是改进的新版的。

条理清晰 论证充足

学了1、2、3、6、9、10章，姜老师讲课远超预期的棒。了解了一些以前计量课没涉及的方面和细节。

[金融计量学_下载链接1](#)

书评

·
最后一章很明显罗列公式草草了事，那一堆公式我不认为不读附录的论文能看的明白。这本书其实倒数四章反而写的算比较清楚的，就算是姜近勇自己的论文改编的内容材料比如特征函数估计法里面jiang-knight2002的公式罗列还算可以接受，但是最后一章的罗列的那一堆市场微观结构比...

[金融计量学_下载链接1](#)