

图书基本信息

书名：<<经济、金融计量学中的非参数估计技术>>

13位ISBN编号：9787030190291

10位ISBN编号：7030190297

出版时间：2007-6

出版时间：科学

作者：李竹渝，鲁万波，

页数：154

字数：192000

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

本书利用非参数估计技术处理含有不确定性的、与实际现象密切联系的经济、金融模型。主要内容包括：非参数核密度估计方法及其在金融资产收益率分布估计、资产组合相依结构Copula研究上的应用；常用非参数回归估计方法、基本统计性质及其在计量经济模型中的应用以及非参数估计技术在金融时间序列分析中的应用。

本书适合应用数学专业，特别是经济、管理和统计专业的高年级本科生、研究生及青年教师阅读。可作为经济、管理类研究生学位课、选修课教材或参考书，也适合于实际从事经济管理、计量金融类的专业人员和有兴趣了解现代非参数估计技术的广大读者。

## 书籍目录

第1章 引言 1.1 计量经济模型简述 1.2 非参数估计方法简介 参考文献第2章 非参数密度估计及其应用 2.1 非参数密度估计简介 2.2 非参数密度估计的基本性质与光滑参数的选取 2.2.1 非参数核密度估计的基本统计性质 2.2.2 光滑参数的选取 2.2.3 密度函数导函数的估计与光滑参数选取的DPI方法 2.2.4 核函数的选取与光滑参数 2.3 线性回归模型误差分布的非参数核密度估计 2.4 非参数密度估计对金融资产收益率分布估计的探索 2.5 Copula方法简介 2.6 分析资产组合相依结构的非参数核密度估计——ML两步法 2.7 中国A股市场相关结构的实证研究 参考文献 第2章附录第3章 非参数回归及其相关问题” 3.1 非参数回归模型简介 3.2 非参数回归函数N—W核估计 3.3 核函数估计的基本性质 3.4 其他非参数回归估计方法 3.5 光滑参数的选择及其相关问题 3.5.1 选择光滑参数的标准 3.5.2 选择光滑参数的方法 3.5.3 相关问题的讨论 3.6 非参数回归估计在经济计量模型分析中的应用 参考文献 第3章附录第4章 金融时间序列分析的非参数估计技术 4.1 引言 4.2 混合样本序列的非参数密度函数估计 4.3 金融资产收益率波动性的非参数函数估计 4.3.1 波动性的核回归函数估计 4.3.2 波动性的局部多项式估计 4.3.3 金融资产收益率波动性非参数函数估计的实证分析 4.4 金融时间序列的非参数技术 4.4.1 非参数GARCH模型 4.4.2 非参数ACD模型 参考文献 第4章附录附录常用概率核密度函数及其函数值表后记

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>