第一图书网, tushu007.com

<<金融时间序列模型>>

图书基本信息

书名：<<金融时间序列模型>>

13位ISBN编号：9787811342871

10位ISBN编号：7811342871

出版时间：2008-11

出版时间：对外经济贸易大学出版社

作者：潘红宇

页数：339

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

前言

奉献在读者面前的这套教材，由对外经济贸易大学国际经济贸易学院教师根据多年的教学科研经验精心编写，从我国加入世界贸易组织五年过渡期结束后的2007年初开始陆续出版，是一项重要的教材建设工程。
它与我国改革开放的新时代同步发展，标志着我院为国家培养创新型高等人才所作出的一份特殊贡献。
我院历来重视教材建设，秉承50多年学科建设的经验积累，在国际经济与贸易、金融、国际运输与物流、经济学等专业领域先后出版了大量教材，在全国产生了较大的影响。
如《国际贸易实务》、《国际贸易》等累计发行近150万册，先后被评为国家级精品课程。
本系列教材的出版，是对我院近十年来学科建设成果的一次检阅。
自“九五”以来，以“211工程”建设为契机，我院对本科和研究生教育进行了认真全面的专业梳理和课程体系优化，以面向新世纪、面向全球化、面向提升学生职业生涯竞争力为导向，在课程建设和教材建设方面视野开阔、目标明确、标准严格、工作扎实，老中青三代学者共同努力，基本完成了学院所开设专业课程的教材和教学辅助资料的编写工作。
回顾我院“九五”以来课程体系建设，我们走过了一条清晰的发展之路。
首先是课程群的界定和建设，我们抓住20世纪90年代中期我国全面推进改革开放所带来的对外向型经济人才的需求急速增加的机遇，围绕着我院长期积累的在国际经济与贸易、国际金融、国际运输与物流等专业所形成的专业优势，借鉴国际上高水平大学的课程建设经验，设定了培养学生具有国际竞争力所需要的课程群。
在此基础上狠抓师资队伍建设，通过海内外招聘和支持现有教师在国内外攻读博士学位，以国际化的高标准打造了一支高水平的师资队伍，凝聚了学科建设的核心力量。
然后以国际高水平大学的科研和教学标准评价师资队伍，以高水平科研促进高水平教学，实现科研与教学的相互促进。
随着学科建设的不断进步，我院的专业领域和课程覆盖面均有了很大的突破。

第一图书网, tushu007.com

内容概要

全书包括七章。
第一章金融和统计基本概念。
第二章时间序列数据回归模型，第三章确定性时间序列分析，第四章平稳线性ARMA模型。
第五章波动率模型，第六章非平稳时间序列模型，第七章模拟。
本教材由浅入深，循序渐进，以应用为主。
提供了大量金融领域使用的案例。
每章配有本章要点，关键词和需要掌握的内容。
每章后配有思考题和上机练习题，同时提供大量数据以方便练习。
每章都提供相应的Eviews5．O操作指南。
本教材还提供配套的PPT和试卷。
　本书是高等院校经管类本科，研究生的首选教材。
也可作为金融时间序列，计量经济学相关领域学者的参考读物。

<<金融时间序列模型>>

书籍目录

第一章 金融和统计基本概念　第一节 收益率　第二节 正态分布和对数正态分布　第三节 描述统计　第四节 协方差和相关系数　第二章 时间序列数据回归模型　第一节 经典线性回归模型　第二节 时间序列数据回归模型的假设条件　第三节 动态计量经济模型　第四节 模型的评价和修改　第三章 确定性时间序列分析　第一节 时间序列的分解　第二节 平滑方法　第三节 拟合趋势　第四节 趋势和季节调整　第四章 平稳线性ARMA模型　第一节 随机过程的基本概念　第二节 ARMA模型与相应平稳随机过程　第三节 线性ARMA模型的建立　第四节 预测　第五节 季节性ARMA模型　第五章 波动率模型　第一节 波动率模型概述　第二节 自回归条件异方差模型（ARCH）　第三节 广义自回归条件异方差模型（ARCH）　第四节 非对称条件异方差模型　第五节 ARCH-M模型　第六节 风险价值　第六章 非平稳时间序列模型　第一节 趋势平稳过程和单位根过程　第二节 单位根检验　第三节 协整定义和性质　第四节 协整检验　第七章 模拟　第一节 产生服从已知分布的随机数　第二节 模拟的使用　第三节 降低方差的方法　第四节 马尔可夫链蒙特卡罗模拟法　参考文献

章节摘录

第一章　金融和统计基本概念　　本章摘要　　本章包括两部分内容，第一部分是关于收益率的一些计算。
在金融市场上收集到的原始数据是资产的价格，但是比较不同投资活动时，价格并不是一个很好的指标，通常要计算金融资产的收益率。
收益率有多种计算方法，这些在第一部分介绍。
对收益率建立模型之前，一般对收益率进行一些描述统计来了解收益率的统计特征。
不同金融资产收益率的协方差和相关系数对构造资产组合起重要作用。
所以第二部分介绍了对收益率的基本统计分析——描述统计和不同资产之间相关程度的度量。
　　本章关键词　　收益率　年收益率　几何平均　描述统计　偏度　峰度　对数正态分布　协方差　相关系数　　学完本章，你需要掌握：　　计算单周期简单收益率和对数收益率的方法；　　把收益率年度化，包括计算简单年收益率，复利年收益率，连续复利年收益率。
理解连续复利的含义；　　对于多周期投资活动，计算单周期的几何平均收益率，比较不同投资活动收益率的大小；　　可以使用程序得到单支金融资产收益率的描述统计结果，根据样本均值、样本方差、样本偏度、样本峰度、Q—Q图和JB检验得到收益率的基本分布特征。
对不同资产可以根据历史收益率得到方差一协方差阵和相关系数阵，为构造资产组合做准备。

编辑推荐

《金融时间序列模型》主要介绍定量分析时间序列数据的方法，《金融时间序列模型》与实践序列分析类教材的不同之处在于，针对金融专业本科生的特点，使用大量金融领域中的案例，强调概念的理解和应用而不是理论推导。
《金融时间序列模型》是高等院校经管类本科，研究生的首选教材。
也可作为金融时间序列，计量经济学相关领域学者的参考读物。

第一图书网, tushu007.com

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