

绪 论	1
第一节 金融计量概论	1
第二节 单方程建模导读	3
第三节 多元方程建模导读	4

| 第一篇 |

单方程建模

第一章 资产收益率及其分布	11
第一节 资产价格与收益率	11
第二节 资产收益率的分布	15
第三节 收益率分布的小概率区制:极值理论	19
本章小结	24
课后习题	24
第二章 收益率方程建模:自回归移动平均模型	26
第一节 时间序列初步	26
第二节 自回归过程	32
第三节 移动平均过程	50
第四节 自回归移动平均过程	57
第五节 自回归移动平均模型估计	60
本章小结	68
课后习题	69

第三章	波动率方程建模：条件异方差模型	71
第一节	自回归条件异方差模型构建	71
第二节	GARCH 族模型	76
第三节	非对称 GARCH 模型	80
第四节	Jump-GARCH 模型	83
第五节	BEKK-GARCH 模型	89
第六节	随机波动模型	93
	本章小结	96
	课后习题	96
第四章	波动率方程建模：混频条件异方差模型	98
第一节	GARCH-MIDAS 建模	98
第二节	ARCH-MIDAS 建模	102
第三节	EWMA-MIDAS 建模	104
第四节	T(E)GARCH-MIDAS 建模	105
第五节	APARCH-MIDAS 建模	108
	本章小结	110
	课后习题	111
第五章	单方程回归建模：协整与误差修正模型	112
第一节	单位根检验	112
第二节	协整检验	123
第三节	协整估计：DOLS 和 FMOLS 方法	126
第四节	自回归分布滞后模型	129
第五节	非平稳序列建模：误差修正模型	132
	本章小结	135
	课后习题	135

| 第二篇 |

多元方程建模

第六章	多元方程建模：向量自回归模型	139
第一节	向量自回归模型介绍	139

第二节	模型估计	141
第三节	格兰杰因果关系检验	144
第四节	脉冲响应函数	146
第五节	方差分解	149
第六节	VAR 建模的案例实现	151
	本章小结	159
	课后习题	159
第七章	扩展向量自回归模型族	161
第一节	长期约束结构向量自回归模型	161
第二节	贝叶斯向量自回归模型	164
第三节	高维向量自回归模型	174
第四节	面板向量自回归模型	178
第五节	全局向量自回归模型	186
	本章小结	193
	课后习题	194
第八章	非线性向量自回归模型族	197
第一节	门限向量自回归模型	197
第二节	逻辑平滑转移向量自回归模型	201
第三节	指数平滑转移向量自回归模型	205
第四节	区制转移向量自回归模型	207
	本章小结	213
	课后习题	213
第九章	时变参数向量自回归模型族	215
第一节	时变参数向量自回归模型	215
第二节	时变参数高维向量自回归模型	218
第三节	时变参数潜在门限向量自回归模型	223
第四节	时变参数因子增广型向量自回归模型	226
第五节	时变参数面板向量自回归模型	230
	本章小结	237
	课后习题	237

第十章 动态随机一般均衡：向量自回归模型	240
第一节 动态随机一般均衡模型介绍	240
第二节 动态随机一般均衡模型构建	243
第三节 动态随机一般均衡模型范式：非线性化求解	246
第四节 动态随机一般均衡模型范式：线性化求解	253
第五节 动态随机一般均衡模型的应用与批评	258
本章小结	260
课后习题	260