

<<应用计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<应用计量经济学>>

13位ISBN编号：9787111388012

10位ISBN编号：7111388011

出版时间：2012-8

出版时间：机械工业出版社

作者：沃尔特·恩德斯

页数：374

译者：杜江,袁景安

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>

<<应用计量经济学>>

内容概要

沃尔特·恩德斯编写的《应用计量经济学：时间序列分析(原书第3版)

》是一部计量经济学领域的优秀教材，全书自始至终贯穿由浅入深、由简单到复杂的学习过程，运用真实的数据举例，阐述关键概念，不但完整、精简，而且非常注重应用。

本书通过案例强调方法的实际应用，几乎没有复杂的数学公式。

全书共分7章，分别介绍了差分方程、平稳时间序列模型、波动性建模、包含趋势的模型、多方程时间序列模型、协整与误差修正模型以及非线性时间序列模型等内容。

《应用计量经济学：时间序列分析(原书第3版)》可作为经济类、管理类以及其他学科的本科高年级或研究生的计量经济学教材，同时也是科研工作者和实际工作者十分有用的参考用书。

<<应用计量经济学>>

作者简介

沃尔特·恩德斯(Walter Ende), 美国亚拉巴马州立大学的经济学教授, 1975年他获得纽约哥伦比亚大学经济学博士学位。恩德斯博士最近的研究集中于时间序列模型在经济学和金融领域的发展与运用。他已经在许多期刊上发表了多篇论文, 这些期刊包括: Review of Economy and Statistics, Quarterly Journal of Economics, Journal of International Economics, American Economic Review(美国经济协会主办), Journal of Business and Economic Statistics(美国统计协会主办)以及The American Political Science Review(美国政治科学协会主办)。

他现担任国际经济学领域的三种期刊的正式编辑, 以及乌克兰政府的政策顾问。他还因防止核战争方面的行为科学研究, 与托德·森德勒(Todd Sandler)分享了美国国家科学院的: ESTES奖。

该奖项的认定中提到, “...认知与行为科学领域的基础研究, 运用规范分析或实证方法, 或两者的最佳结合, 加深了我们对有关核战危机的认识。” 国家科学院授予他们该奖项是因为他们“...对跨国恐怖活动的共同研究, 即运用博弈论和时间序列分析证明了恐怖袭击对防御性反制措施的反应具有循环性和易变性的特征。”

<<应用计量经济学>>

书籍目录

中文版序

译者序

作译者简介

前言

第1章 差分方程

1.1 时间序列模型

1.2 差分方程及求解方法

1.3 迭代法求解方程

1.4 备选方法

1.5 蛛网模型

1.6 解齐次差分方程

1.7 求确定性过程的特解

1.8 待定系数法

1.9 滞后算子

1.10 总结

习题

注释

附录1A 虚根和De Moivre定理

附录1B 高阶方程中的特征根

第2章 平稳时间序列模型

2.1 随机差分方程模型

2.2 自回归移动平均ARMA模型

2.3 平稳性

2.4 ARMA(p, q)模型的平稳性限制

2.5 自相关函数

2.6 偏自相关函数

2.7 平稳序列的样本自相关

2.8 Box-Jenki模型筛选方法

2.9 预测性质

2.10 利率差模型

2.11 季节性模型

2.12 参数稳定性和结构变化

2.13 总结

习题

注释

附录2A MA(1)过程的估计

附录2B 模型筛选准则

第3章 波动性建模

3.1 定式化的经济时间序列

3.2 ARCH过程

3.3 通货膨胀的ARCH和GARCH估计

3.4 GARCH模型的两个例子

3.5 风险的GARCH模型

3.6 ARCH-M模型

3.7 ARcH过程的其他性质

<<应用计量经济学>>

3.8 GARCH模型的最大似然估计

3.9 其他条件方差模型

3.10 估计纽约证券交易所综合指数

3.11 多元GARCH模型

3.12 总结

习题

注释

附录3A 多元GARCH模型

第4章 包含趋势的模型

4.1 确定性趋势和随机趋势

4.2 去除趋势

4.3 单位根与回归残差

4.4 蒙特卡洛方法

4.5 DF检验

4.6 DF检验实例

4.7 扩展的DF检验

4.8 结构性变化

4.9 有效性与确定性回归变量

4.10 有效性更好的检验

4.11 Panel单位根检验

4.12 趋势和单变量分解

4.13 总结

习题

注释

附录4A 自助法

附录4B 确定性回归变量的确定

注释

第5章 多方程时间序列模型

5.1 干扰分析

5.2 传递函数模型

5.3 估计传递函数

5.4 结构性多元估计的约束

5.5 向量自回归介绍

5.6 估计和识别

5.7 脉冲响应函数

5.8 假设检验

5.9 简单的VAR实例：西班牙的恐怖事件和旅游业

5.10 结构性VAR

5.11 结构性分解实例

5.12 Blanchard-Quah分解

5.13 实例：分解实际汇率与名义汇率变动

5.14 总结

习题

注释

第6章 协整与误差修正模型

6.1 单整变量的线性组合

6.2 协整与共同趋势

<<应用计量经济学>>

6.3 协整与误差修正模型

6.4 协整检验：Engle—Granger检验方法

6.5 协整检验：Engle—Granger检验方法演示

6.6 协整和平价购买力理论

6.7 特征根、秩与协整

6.8 假设检验

6.9 Johaen协整检验方法

6.10 误差修正和AD[α]检验

6.11 三种方法的比较

6.12 总结

习题

注释

附录6A 特征根、平稳性与秩

附录6B 协整向量推导

第7章 非线性时间序列模型

7.1 线性与非线性调整

7.2 ARMA模型的简单扩展

7.3 非线性检验

7.4 门限自回归模型

7.5 TAR的扩展形式

7.6 三个门限模型

7.7 平滑转换模型

7.8 其他状态转换模型

7.9 平滑转换自回归模型的估计

7.10 一般化的脉冲响应及其预测

7.11 单位根与非线性

7.12 总结

习题

注释

统计表

参考文献

<<应用计量经济学>>

章节摘录

版权页：插图：对 $a_0 / (1-b_1)$ 与求和公式 $\sum_{i=0}^{t-1} b_1^i$ 中的每一个元素再次运用该原则可得到特解。

如果我们想知道序列的实际系数，那么，最好采用待定系数法。

滞后算子的魅力在于它们能够简洁地标记特解，其一般模型 $A(L)y_t = a_0 + B(L)y_{t-1}$ 的特解为 $y_t = a_0 / A(L) + B(L)y_{t-1} / A(L)$ 正如式 (1—82) 所揭示的，任何线性差分方程都有一个前向解 (forward-looking)。

本书将不大运用到前向解，因为随机变量的未来值不能被直接观察到，关于前向解的一些细节的相关内容可在 www.cba.ua.edu/~wenders 的补充手册 (supplementary Manual) 上查阅。

1.10 总结 时间序列计量经济学是关于包含随机成分在内的差分方程的估计，时间序列模型通常被用于预测。

由于序列的可预测成分能够外推至未来的时刻，所以揭示序列的动态路径可使得预测精度大为改善。随着人们对动态经济学的兴趣日益增加，时间序列计量经济学已经开始受到新的重视。

经过恰当估计的方程可以用于经济数据的解释和假设检验。

本章的介绍着重在“求解”随机差分方程的方法。

尽管迭代法或许很有用，但使用它在许多情况下并不现实。

线性差分方程的解可以被划分为两部分：特解和齐次解。

麻烦之处在于齐次解不是唯一的。

通解是一个特解和所有齐次解的线性组合。

对一个 n 阶差分方程施加 n 个初始条件可得到唯一解。

差分方程的齐次部分是对初始期非均衡的一种衡量。

之所以齐次差分方程特别重要，是因为它可以得到特征根，一个 n 阶差分方程有 n 个这样的特征根。

如果所有的特征根都位于单位圆内，则序列收敛。

正如我们将在第2章看到的，稳定性条件和一个经济变量是否平稳具有直接关系。

待定系数法和使用滞后算子的方法是求特解的有力工具，特解是推导过程的现在值和过去值的线性函数。

此外，特解也可能是包含一个截距项和一个时间的多项式函数。

要求对单位圆以外的单位根和特征根施加初始条件以使特解变得有意义。

有些经济模型具有前向解，那么，在这种情况下，可预测的未来事件就会对当期产生影响。

本章提到这些工具，目的在于为学习时间序列计量经济学铺平道路。

毫无疑问，做本章后面的习题也是十分有益的。

特征根、待定系数法和滞后算子将在本书的后面部分出现。

<<应用计量经济学>>

编辑推荐

<<应用计量经济学>>

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>