

<<非平稳综列数据分析>>

图书基本信息

书名：<<非平稳综列数据分析>>

13位ISBN编号：9787500489184

10位ISBN编号：7500489188

出版时间：2010-12

出版时间：中国社会科学出版社

作者：杨继生.

页数：240

字数：200000

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>

## <<非平稳综列数据分析>>

### 内容概要

本书主要的理论创新包括：(1)在综列单位根检验方面，基于ADF检验建立了联合p值检验统计量，发现和修正了非线性工具变量检验统计量的有偏性，建立了具有普适性的广义非线性工具变量(GNIV)检验统计量，并且给出了这一统计量的理论和经验分布。

(2)在综列协整方面，给出了基于PVECM的检验统计量在各种设定形式下的临界值，建立了基于PVECM的无约束似然比综列协整检验统计量。

最后，在应用方面，本书分别通过基于残差的综列协整检验、基于PVECM的综列协整检验和单独应用综列单位根检验，分析了我国工业能源消费、人民币均衡汇率以及我国证券市场的弱有效性，为综列单位根和综列协整的应用研究提供了完整的范例。

这些应用性研究，不仅体现了丰富的经济学含义，也说明本书的理论研究对我国的综列数据具有适用性，具有显著的应用价值。

## <<非平稳综列数据分析>>

### 作者简介

杨继生 华中科技大学经济学院副教授，博士生导师，中国数量经济学会理事。

研究方向：综列(面板)数据模型理论与应用。

在《Journal of

Econometrics》、《中国社会科学》、《经济研究》、《新华文摘》、《数量经济技术经济研究》、《管理科学学报》、《经济学家》、《统计研究》、《系统工程理论与实践》等期刊发表相关论文十余篇。

## &lt;&lt;非平稳综列数据分析&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第一章 引言

## 第二章 现有综列单位根和综列协整研究文献综述及分析

## 第一节 现有综列单位根检验综述及分析

## 一 基于截面不相关假定的综列单位根检验

## 二 基于截面相关假定的综列单位根检验

## 第二节 现有综列协整检验综述及分析

## 一 基于残差的综列协整检验

## 二 基于综列误差纠正模型的综列协整检验

## 第三章 现有综列单位根检验的修正和扩展

## 第一节 联合p值检验的扩展：一种第一代检验的扩展

## 一 联合p值检验统计量的构造和渐近分布

## 二 基于ADF的联合p值检验及其仿真

## 三 联合p值检验在截面弱相关下的总体表现

## 第二节 非线性工具变量法检验的修正：一种第二代检验的问题与修正

一  $S_n$ 检验统计量及其渐近性质二 数据含确定性成分时 $S_n$ 统计量的有偏性及其修正三 修正前后 $S_n$ 检验统计量的仿真结果及其比较

## 四 研究结论

## 第三节 广义非线性工具变量法检验：一种更具一般性的检验

## 一 模型及其假定

## 二 广义非线性工具变量法检验(GNIV)

## 三 仿真试验

## 四 研究结论

## 第四章 现有综列协整检验的扩展

## 第一节 基于有约束PVECM的综列协整检验统计量的数值分布

## 一 Groen和Kleibergen(2003)基于PVECM的综列协整检验

## 二 临界值的估计

## 三 研究结论及说明

## 第二节 基于无约束PVECM的综列协整似然比检验

## 一 正则相关分析

## 二 无约束综列协整模型的检验和估计

## 三 基于自举法仿真的检验

## 四 仿真实验

## 五 无约束综列协整检验的特点

## 第五章 对中国经济的应用性研究

## 第一节 综列单位根和综列协整在中国经济研究中的应用现状

## 第二节 中国的工业能源消费：基于残差的综列协整分析

## 一 研究背景

## 二 中国工业能源消费的综列协整模型

## 三 估计与检验

## 四 研究结论及说明

## 第三节 人民币均衡汇率和调整预期：基于PVECM的综列协整分析

## 一 研究背景

## 二 模型和样本

## 三 综列单位根和综列协整检验

## <<非平稳综列数据分析>>

四 检验和估计结果分析

五 研究结论及说明

第四节 中国证券市场的弱有效性检验：综列单位根检验单独应用实例

一 问题的提出

二 样本数据

三 检验结果及分析

四 研究结论

第六章 总结与说明

参考资料

附录 仿真、估计和检验程序

<<非平稳综列数据分析>>

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>