

<<宏观经济计量分析方法与模型>>

图书基本信息

书名：<<宏观经济计量分析方法与模型>>

13位ISBN编号：9787505856165

10位ISBN编号：7505856162

出版时间：2005-12

出版时间：经济科学出版社

作者：马树才

页数：507

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>

## <<宏观经济计量分析方法与模型>>

### 内容概要

宏观经济是从宏观、总体上研究国民经济水平、结构、均衡、运行、稳定、调控和增长等的一个经济研究范畴或领域。

从宏观、总体上研究国民经济或者其某一方面，必然要和一些宏观经济变量及其所反映出的数据资料打交道，研究这些经济变量之间的相互关系及其所反映出的宏观经济或其某一方面所具有的规律性，而这就需要采用宏观经济计量分析方法，建立宏观经济计量分析模型，并应用之。

因此，所谓宏观经济计量分析，不过是指运用经济理论、事实和统计理论，度量宏观经济变量之间的关系，并对其进行经验检验的过程和一整套模型方法体系。

宏观经济计量分析方法与模型在宏观经济研究中具有重要地位，它无论是在宏观经济学的发展过程、理论研究，还是实际应用中都起到了重要作用。

它不仅是经济计量学的核心内容，同时，也是宏观经济学的重要组成部分。

本书具有的显著特点是：对各种不同经济计量分析模型的提出，强调了它应满足的条件，这样既有利于实际工作者在宏观经济研究中应用，又便于在实际应用中对模型进行选择；在模型的计量分析方法的写作上，注重必要的计算过程，忽略较繁琐的数学推导，这样便于阅读和理解；对同一计量分析模型，尽可能地把所有可能的计量分析方法都安排在同一章中，这样做便于读者学会如何察这些方法和模型运用在宏观经济计量分析研究中。

## &lt;&lt;宏观经济计量分析方法与模型&gt;&gt;

## 书籍目录

导论 一、宏观经济计量分析释义 二、宏观经济计量分析模型范式 三、宏观经济计量分析模型构造 四、宏观经济计量分析方法体系 五、宏观经济计量分析方法与模型的应用 第一篇 经典计量分析方法与模型 第1章 单方程经济计量模型 1.1 单方程模型计量分析基本原理 1.2 生产函数 1.3 消费函数 1.4 需求函数 1.5 投资函数 1.6 货币需求函数 第2章 单方程模型的计量分析方法 2.1 经典假设条件下的最小二乘估计(OLS) 2.2 经典假设条件下的极大似然估计(ML) 2.3 经典假设带约束条件下单方程模型的估计 2.4 矩估计法(GMM) 2.5 贝叶斯估计法(BAYES) 第3章 联立方程经济计量模型 3.1 联立方程模型概述 3.2 联立方程模型计量分析基本原理 3.3 联立方程模型的识别 第4章 联立方程模型的计量分析方法 4.1 联立方程结构式模型单方程估计法(一) 4.2 联立方程结构式模型单方程估计法(二) 4.3 联立方程结构式模型联立方程估计法 第5章 宏观经济的一般均衡分析 5.1 瓦尔拉斯一般均衡 5.2 一般均衡的稳定性分析 5.3 供给与需求的一般均衡分析 第二篇 非经典计量分析方法与模型 第6章 非经典假设下单方程模型计量分析方法 6.1 非球面扰动模型及其计量分析 6.2 非正态扰动模型的渐近分析 6.3 多重共线性模型及其计量分析 6.4 随机解释变量模型的渐近分析 第7章 非线性回归模型的计量分析 7.1 非线性经济计量模型概述 7.2 可线性化的非线性经济计量模型 7.3 不可线性化的非线性经济计量模型 7.4 非线性联立方程模型 第8章 变参数线性模型的计量分析 8.1 变参数线性回归模型概述 8.2 确定性变参数线性回归模型 8.3 随机性变参数线性回归模型 第9章 无参数回归模型及其计量分析 9.1 无参数回归模型概述 9.2 单方程无参数回归模型的估计 9.3 联立方程无参数模型的估计 第10章 半参数回归模型的计量分析 10.1 线性回归半参数模型的估计 10.2 线性半参数回归模型的OLS估计 10.3 非线性半参数回归模型的OLS估计 第11章 平行数据模型及其计量分析 11.1 平行数据模型概述 11.2 固定效应模型及其计量分析 11.3 随机效应模型及其计量分析 11.4 平行数据扩展模型 11.5 兼顾地区比较的居民消费模型 第12章 宏观经济非均衡分析 12.1 非均衡经济计量学基本模型 12.2 单一市场非均衡经济计量模型的估计 12.3 多市场非均衡经济计量模型的估计 12.4 宏观经济非均衡模型实例 第三篇 动态计量分析方法与模型 第13章 平稳序列与ARMA模型 13.1 平稳时间序列与ARMA模型 13.2 ARMA模型的计量分析 13.3 ARMA模型建模步骤及实例 13.4 ARIMA模型及实例 第14章 自回归与分布滞后模型 14.1 分布滞后模型及其计量分析 14.2 货币存量与产出变动反应的分布滞后模型 14.3 自回归分布滞后模型(ADL)及其计量分析 14.4 向量自回归模型(VAR(p)) 14.5 误差校正模型及其估计 第15章 单位根过程及其检验 15.1 非平稳过程与中心极限定理的失效 15.2 单位根过程的极限分布 15.3 单变量单位根过程的假设检验 15.4 GDP时间序列的平稳性检验 15.5 AR(p)模型的单位根检验 第16章 协整过程及其计量分析 16.1 协整过程及Granger表示定理 16.2 协整向量的估计 16.3 协整性检验 16.4 协整系统的ML估计及协整向量的检验 16.5 购买力平价的协整分析 第17章 自回归条件异方差模型 17.1 自回归条件异方差模型(ARCH) 17.2 线性ARCH(q)模型的计量分析 17.4 即日收益易变性过程的GARCH分析 附表 参考文献

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>