

<<21世纪数量经济学>>

图书基本信息

书名：<<21世纪数量经济学>>

13位ISBN编号：9787508461335

10位ISBN编号：7508461339

出版时间：2008-12

出版时间：水利水电出版社

作者：汪同三，唐绍祥 主编

页数：364

字数：442000

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>

<<21世纪数量经济学>>

内容概要

本书是《21世纪数量经济学》丛书的第九卷。

中国数量经济学会2008年年会于5月16~18日在宁波大学召开。

著名经济学家、诺贝尔经济学奖得主罗伯特·蒙代尔出席大会并作了主题演讲，中国社会科学院学部委员、学会理事长汪同三教授在开幕式上致辞，并在闭幕式上作了总结讲话。

学会副理事长唐绍祥教授、常务副理事长李富强教授分别主持了年会的开幕式和闭幕式。

418名学会会员和相关代表参加了年会，会议收到论文324篇。

本届年会是参会人数最多，收到论文最多的一届年会。

年会上，东北财经大学高铁梅教授就“经济周期波动研究中的滤波方法”作了学术报告；清华大学李子奈教授、南开大学张晓峒教授、上海社会科学院朱平芳教授、中国人民大学赵国庆教授分别就数量经济学的经典理论或方法在名家讲坛上作了讲座。

根据提交论文的选题，年会分为8个组进行了学术交流。

60多位学者在小组讨论会上作了学术交流，介绍了自己的最新研究成果。

本书收入从本次年会参会论文中遴选出来的优秀论文共40篇，分为7个部分：数量经济理论与方法，宏观经济增长与发展，金融、资本市场，财政、税收、投资、贸易，区域经济、协调发展，企业、产业经济，博弈论、实验经济学及其他。

我们认为，入选的这些论文均有较高的学术水平，具有较强的理论意义或实际意义，从一个侧面代表了中国数量经济学的研究水平。

另外，年会也收到若干篇具有个人独立见解，颇能引人思考的论文，考虑到这些文章目前还存在一定争议，故此次暂未收录，但我们仍然充分肯定和赞赏这些作者的探索精神。

我们希望通过年会的学术交流和本书的出版，不断提高中国数量经济学研究的学术水平，促进数量经济学科体系的不断完善和发展。

<<21世纪数量经济学>>

书籍目录

前言一 数量经济理论与方法 局部线性工具变量估计在边界点的性质 有效矩方法中结构突变检验的一个方法 Anselin空间面板模型的一致快速估计 近似因子模型的Panel单位根检验 非线性模型理论及其应用研究 技术差异、技术差异与总量生产函数加总问题研究 凸约束的评估模型与TFP测度 识别概念的允许变换说质疑二 宏观经济增长与发展 中国金融发展、储蓄率与经济增长间的动态影响机制 资本账户自由化对发展中国家短期经济增长的影响：理论和实证 我国产业结构变化对经济周期波动的影响研究 卢卡斯方差假说在中国成立吗？——基于时变参数模型的实证研究 亲贫困增长的公理性标准及其测度指标 信息产业对我国经济发展影响分析三 金融资本市场 我国流动性过剩外部传染效应的实证检验 上海股市泡沫经济的实证分析 深圳股票市场与证券投资基金市场相互关系的实证研究 基于SFA模型对我国商业银行经济效率的测度与研究 企业集团客户贷后信用风险的识别研究 KSF投资组合选择模型的若干结果 基于混合ARCH模型的风险值VaR 基于Markov区制转换的股市投机泡沫实证研究四 财政税收投资贸易 我国房地产投资周期波动的特征——基于主成分分析方法构建我国房地产投资景气指数 引进外资与我国对外贸易发展的省际间差异性 民营企业的对外贸易与经济增长 李嘉图等价定理的研究回顾和中国实证 FDI对内资企业技术溢出绩效分析五 区域经济发展 货币紧缩政策下的区域股票价格调整幅度实证研究 欠发达地区城镇功能完善与第三产业可持续发展互动关系定量研究 山东省劳动力就业需求组合预测研究 预防性储蓄对各省城镇居民消费结构影响分析六 企业产业经济 房地产产业关联度分析 资金流动性与制造业产能利用率周期波动的关联性研究 第一产业增长与结构变化 农业产业化组织变迁的供需均衡分析 企业自主创新活力评价及实证研究 七 博弈论实验经济学及其他 股票市场机构投资者共谋违规行为监管的博弈分析与动态仿真研究 求解有限信号博弈的提炼贝叶斯均衡的表格化方法 博弈学习模型研究进展 考虑生产能力的VMI系统收入共享契约的制定

章节摘录

插图：局部线性工具变量估计在边界点的性质叶阿忠、李子奈（1.福州大学管理学院；2.清华大学经济管理学院）引言非参数计量经济模型的研究是当前计量经济学研究中的一个重要方向〔1-7〕，其中非参数单方程计量经济模型的研究在近30年间得到了迅速的发展并趋于成熟〔1-2, 5-7〕，非参数联立方程计量经济模型的研究也取得了较为丰富的成果〔1-2, 8〕。

联立方程计量经济模型在经济政策制定、经济结构分析和经济预测方面具有重要作用〔9〕，与传统联立方程模型相比，非参数联立方程模型能更好地描述现实经济现象，具有较高的拟合优度。

Newey, Powell和Vella〔8〕，提出了非参数联立方程模型的两阶段正交序列估计方法，并证明其相合性和渐近正态性。

采用局部线性拟合的方法对非参数单方程模型进行估计，已经被认为是研究非参数模型的有效方法〔1-2, 4-7〕。

但是，在单方程模型中是一致估计的方法在联立方程模型中不再是一致估计的方法〔9〕。

叶阿忠和李子奈〔10〕将非参数单方程模型的局部线性估计方法与传统联立方程模型估计方法相结合，提出了非参数计量经济联立模型的局部线性工具变量估计，并在内点处证明了其一致性和渐近正态性。

本文继续这项研究，在边界点处研究了局部线性工具变量估计的大样本性质和收敛速度。结果表明，局部线性工具变量估计在边界点处仍具有一致性和渐近正态性，且收敛速度慢于内点处的收敛速度。

<<21世纪数量经济学>>

编辑推荐

《21世纪数量经济学》由中国水利水电出版社出版。

<<21世纪数量经济学>>

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>