

<<阈值自回归模型和阈值协整理论与方法>>

图书基本信息

书名：<<阈值自回归模型和阈值协整理论与方法研究>>

13位ISBN编号：9787514114423

10位ISBN编号：7514114424

出版时间：2011-12

出版时间：经济科学出版社

作者：刘汉中

页数：227

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>

## <<阈值自回归模型和阈值协整理论与方法>>

### 内容概要

研究表明许多经济变量呈现出非线性动态调整机制，如果仍然采用线性自回归模型来描述这些经济变量的动态机制是不合适的，这无疑对经典时间序列分析方法论提出了新的挑战。

近年来，阈值自回归(Threshold

Autoregression, TAR)方法已成为时间序列非线性建模的主要研究领域之一。

TAR原理方法是基于“分段”线性逼近，即把时间序列分割成几个机制，每个机制上都采用不同的线性自回归模型进行逼近，刻画了时间序列在不同机制中呈现不同的动态特征。

《阈值自回归模型和阈值协整理论与方法研究》针对阈值自回归和阈值协整的理论方法，研究各检验与估计方法的优缺点，对有关检验和估计方法进行改进，从理论上证明改进方法的适用性，并采取Monte—Cado模拟技术揭示新方法相对于旧方法的优越性。

具体而言，本书共分8章内容，从各个方面研究阈值自回归和阈值协整理论方法。

## 作者简介

刘汉中，男，湖南涟源人，毕业于华中科技大学经济学院数量经济学专业，获经济学博士学位，现为湖南商学院经济与贸易学院副教授，校级精品课程《计量经济学》负责人。长期从事《计量经济学》、《计量经济学软件Eviews操作》、与《管理控制与决策模型》等课程的教学。主要研究领域是计量经济学前沿理论方法与应用。

近几年来已在《数量经济技术经济研究》、

《统计研究》和《系统工程理论与实践》等国内著名刊物上公开发表论文20余篇，其中多篇文章被EI检索和被人大复印资料全文转载，主持国家社科基金1项，教育部人文社科规划基金1项，参与多项课题研究。

出版专著1部，参与教材编写3部，同时也是国内多个刊物的匿名审稿专家。

## 书籍目录

## 第一章 绪论

- 第一节 研究意义
- 第二节 国内外相关研究的总体状况
- 第三节 本书的主要内容和创新之处

## 第二章 阈值自回归模型的估计与检验

- 第一节 tar模型概述
- 第二节 单方程两机制tar模型检验和估计
- 第三节 单方程tar检验的mc模拟
- 第四节 阈值向量自回归模型估计与检验
- 第五节 tvar模型检验模拟
- 第六节 tar模型中机制数确定和滞后阶选择
- 第七节 tar模型和m—tar模型的应用研究
- 第八节 本章小结

## 第三章 阈值自回归下的单位根检验可靠性研究

- 第一节 各种常用的单位根检验
- 第二节 阈值自回归模型
- 第三节 非对称性和单位根检验
- 第四节 monte—carlo模拟设计及其结果
- 第五节 非参数方差比检验在非对称单位根检验中的适用性
- 第六节 方差比检验和退势方法
- 第七节 monte—carlo设计与模拟
- 第八节 本章小结

## 第四章 两机制非对称单位根检验

- 第一节 enders和granger(1998)的非对称单位根检验
- 第二节 berben和dick van dijk(bvd)方法(1999)
- 第三节 caner和hansen(2001)方法(ch)
- 第四节 检验势和检验水平模拟
- 第五节 rbb对eg法改进后的进一步研究
- 第六节 各种方法优缺点及比较
- 第七节 本章小结

## 第五章 三机制非对称单位根检验

- 第一节 特殊三机制模型及理论基础
- 第二节 两机制与特殊三机制tar模型的几何遍历性
- 第三节 三机制的非对称单位根检验
- 第四节 自助法在非对称单位根检验中的应用
- 第五节 对改进后ks方法的mc模拟
- 第六节 本章小结

## 第六章 阈值协整检验方法及其应用研究

- 第一节 阈值协整的经济意义
- 第二节 阈值协整检验方法概述
- 第三节 非对称单位根检验与阈值协整检验
- 第四节 eg(1998)方法在协整检验中的应用
- 第五节 m . seo(2006)方法及其修正
- 第六节 修正后的m . seo方法模拟
- 第七节 阈值协整的应用研究

<<阈值自回归模型和阈值协整理论与方法>>

- 第八节 本章小结
- 第七章 阈值自回归模型参数估计的小样本性质研究
  - 第一节 概述
  - 第二节 各种tar模型及其参数估计
  - 第三节 monte-carlo试验设计与模拟结果
  - 第四节 本章小结
- 第八章 阈值协整参数修正估计法的小样本性质比较研究
  - 第一节 概述
  - 第二节 阈值协整概述
  - 第三节 阈值协整参数的各种估计方法
  - 第四节 monte-carlo模拟设计与研究
  - 第五节 阈值协整中内生性解释变量下参数的推断研究
  - 第六节 本章小结
- 附录部分 eviews 5 . 0程序
- 参考文献
- 后记

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>