第一图书网, tushu007.com

<<面板数据模型的检验方法>>

图书基本信息

书名：<<面板数据模型的检验方法>>

13位ISBN编号：9787514120387

10位ISBN编号：7514120386

出版时间：2012-7

出版时间：陈海燕 经济科学出版社 (2012-07出版)

作者：陈海燕

页数：216

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

<<面板数据模型的检验方法>>

内容概要

《面板数据模型的检验方法》的主要内容为面板数据模型的相关检验方法研究。一方面梳理说明面板数据理论中涉及的检验估计方法；另一方面，紧随国际研究前沿方向，结合现实经济发展现象创新检验方法。

《面板数据模型的检验方法》的特点是：1.全面具体的介绍面板数据模型的检验方法，从选择模型检验到非平稳性检验，力求提高模型设定和估计的准确度。
2.在转变经济结构的宏观大背景下，对结构变化和截面相关的检验方法进行了更多更细的研究，进一步完善了面板数据理论，更有力的推动了实汪研究的可信性。

作者简介

陈海燕，重庆市人。
2004年6月获西南大学数学专业学士学位，2007年6月获天津大学数量经济学专业硕士学位，2010年6月获天津大学技术经济及管理专业博士学位。
现为重庆工商大学经济贸易学院教师。
在《数量经济技术经济研究》、《系统管理学报》、《商业经济与管理》、《统计与信息论坛》等国内核心期刊发表论文10余篇，主持国家社会科学基金西部项目和重庆市社会科学规划青年项目各一项，参与国家自然科学基金项目三项。
主要从事计量经济学理论方法研究及应用。

<<面板数据模型的检验方法>>

书籍目录

第一章引言 第一节面板数据概况 第二节面板数据的特点 第三节面板数据模型的分类 第四节面板数据模型的研究概况 第五节本书主要内容 第二章面板数据模型的基本估计方法 第一节最小二乘估计 第二节广义矩估计 第三节最大似然估计 第四节面板分位数回归 第五节其他估计方法 第三章面板数据模型的基本检验 第一节面板数据模型的协方差分析 第二节基于最大似然估计的检验 第三节面板随机／固定效应检验 第四节面板结构突变点的检验 第五节面板Granger因果关系检验 第六节其他检验方法 第四章面板异方差和序列相关 第一节面板异方差 第二节面板异方差的确定性检验 第三节面板GARCH效应检验 第四节面板序列自相关检验 第五节面板截面相关检验 第六节联合检验 第五章面板单位根检验 第一节截面独立的面板单位根检验 第二节截面相关的面板单位根检验 第三节结构变化的面板单位根检验 第四节面板单位根检验的其他问题 第六章面板协整检验 第一节面板数据伪回归 第二节基于残差的单一协整关系检验 第三节多个协整关系的检验 第四节截面相关的面板协整检验 第五节面板变结构协整检验 第六节面板误差修正模型 第七章面板协整模型的估计与推断 第一节单一方程估计 第二节系统方法估计 第八章基于LSTR的面板变结构协整检验 附录A基本数学工具 附录B概率和统计 附录C极限理论 参考文献 后记

章节摘录

版权页： 插图： 2.面板单位根检验研究现状 在菲利普斯和穆恩（Phillips&Moon，1999）给出了非平稳面板数据的相关渐近极限理论之后，面板单位根检验和协整检验得到迅速发展。
十年来，非平稳面板数据的研究已成为现代计量经济学研究的热点之一。
一般地，在进行协整分析之前，为了避免“伪回归”现象的发生，有必要对序列进行单位根检验，确定序列是否是平稳序列。
因为只有同阶的序列才有可能存在协整关系。
面板单位根检验的研究大致可以分为三个阶段。
第一阶段是假设面板截面之间相互独立，再依据检验式中一阶自回归系数是否相同可以分为同质和异质面板单位根检验，截面独立的同质面板单位根检验有LLC检验、布瑞特（Breitung）检验等。
莱文、林和朱（Levin，Lin＆Chu，2002）对每个截面时间序列进行ADF检验，构造两组相互正交的残差序列，再对正交残差序列合并OLS回归系数的t统计量进行修正，得到修正的t统计量，渐近极限分布为标准正态分布，以此统计量检验面板数据的单位根，此方法称为LLC检验。
截面独立的异质面板单位根检验有IPS检验、费雪－PP检验、费雪－ADF检验等。
伊姆、皮萨然和申（Im，Pesaran&Shin，2003）提出了一个基于截面时间序列DF或ADF统计量的单位根检验方法，简称为IPS检验，IPS检验主要针对存在趋势项或常数项的序列。
马德拉和吴（Maddala&Wu，1999）提出了组合P值检验，是基于费雪（Fisher，1932）的组合统计量，利用相互独立的各时间序列的ADF检验的显著性水平pi取对数的和，此统计量渐近极限分布为X2（2N），此检验的原假设为存在单位根，简称为费雪－ADF（Fisher－ADF）检验。
乔伊（Choi，2001）基于逆正态检验和逻辑（logit）检验提出了面板单位根检验方法，称为费雪－PP（Fisher－PP）检验。
以上检验的原假设均为面板序列存在单位根。

<<面板数据模型的检验方法>>

编辑推荐

《面板数据模型的检验方法》全面具体的介绍面板数据模型的检验方法，从选择模型检验到非平稳性检验，力求提高模型设定和估计的准确度。
在转变经济结构的宏观大背景下，对结构变化和截面相关的检验方法进行了更多更细的研究，进一步完善了面板数据理论，更有力的推动了实证研究的可信性。

第一图书网, tushu007.com

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