

<<财政政策金融政策与协整分析>>

图书基本信息

书名：<<财政政策金融政策与协整分析>>

13位ISBN编号：9787810448475

10位ISBN编号：7810448471

出版时间：2001-06

出版时间：东北财经大学出版社

作者：王雪标

页数：272

字数：226000

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>

<<财政政策金融政策与协整分析>>

内容概要

本书是博士生导师董文泉教授主持的国家社会科学规划基金资助项目“我国财政、金融机制及财政、金融政策协调机制的实证研究”的最终成果之一。

全书分为上篇和下篇两部分。

上篇是基础理论方法部分，我们将系统介绍时间序列分析方法中揭示经济变量之间是否存在长期运行的均衡关系的协整理论方法，有关时间序列的动态建模、误差修正及非平稳数据的推断等理论、方法及应用。

下篇是上述计量经济理论方法的应用部分，我们将主要采用协整理论与误差修正模型等计量经济方法，结合中国的实际情况，对财政政策与金融政策的作用机制及其协调机制进行实证研究。

<<财政政策金融政策与协整分析>>

作者简介

王雪标，教授，1959年出生。
1988年毕业于东北师范大学概率统计专业，获得理学硕士学位。
1995年晋升为副教授。
2000年11月破格提升为教授。
现任数量经济系副主任。
曾主持、完成国家自然科学基金、社会科学基金项目。
完成专著一部、在国家级刊物上发表论文10余篇。

研究方向：经济计量分析

科研成果：

- 1、“关于平稳序列随机变秩顺序统计量的极限分布”，《数学年刊》1991.3；
- 2、“关于平稳序列中心秩顺序统计量联合分布的稳定收敛性”，《应用数学学报》1993.1
- 3、“一类拟平稳序列极值的极限率”，《应用数学学报》1995.1；
- 4、“强相关平稳高斯过程高水平穿过和最大值的弱收敛”，《数学研究与评论》1998.3；
- 5、“正规变化分布正数指数的估计”，《统计研究》1997增刊；
- 6、《财政政策、金融政策与协调分析》，专著。

东北财经大学出版社，2000年；

- 7、“线性综合评价函数的充要条件及权系数确定”，“系统工程理论与实践”2000.10；
- 8、“拟整过程的渐进正态性质”，《（CSIAM.2000）中国工业与应用数学学会第六次年会论文集》北京大学出版社，2000年6月；
- 9、主持“国家自然科学基金项目：我国防范金融危机的MA模型与一体化政策、汇率制度研究”，1997-1999；
- 10、参与“国家社会科学基金项目：我国财政、金融机制及财政金融政策协调机制的实证研究”，1997-1999。

<<财政政策金融政策与协整分析>>

书籍目录

上篇 协整理论与方法 第一章 引言 第二章 时间序列分析中的有关概念 2.1 一维时间序列模型 2.2 几种诊断检验 2.3 多维时间序列模型 2.4 时间序列中的单位根 第三章 单位根检验 3.1 DE检验, ADF检验 3.2 Phillips和Perron检验 (PP检验) 3.3 具有结构性变化的单位根检验 第四章 协整检验 4.1 协整概念 4.2 Engle-Granger检验方法 4.3 Mackinnon检验方法 4.4 误差修正模型 第五章 整过程的统计性质 5.1 整过程的一些性质 5.2 伪回归 5.3 整变量的回归 5.4 拟整过程 第六章 外生性与因果关系 6.1 外生性 6.2 协整和外生性 6.3 Granger因果检验 6.4 超外生性检验 第七章 多维时间序列模型的估计 7.1 VAR的统计分析 7.2 Granger表示定理 第八章 I(1)模型的参数限制及检验 8.1 无限制模型 8.2 长期动态限制 $\Pi = \alpha\beta'$ 8.3 Johansen FIML估计 8.4 几个限制假设的检验 8.5 关于参数 α 的限制及弱外生性 8.6 短期动态和长期动态的限制 (二步方法) 8.7 例子 第九章 I(1)系统中协整向量的几种估计方法及性质 9.1 关于协整向量的几种其他估计方法 9.2 有限样本性质 9.3 滞后长度的进取 9.4 几种协整向量估计的渐近性质 下篇 中国财政、金融政策协调机制的实证研究 第十章 财政金融政策实践回顾 第十一章 财政政策效果分析 第十二章 金融政策影响途径研究 第十三章 财政金融效果时滞研究 第十四章 货币需求函数的误差修正模型 第十五章 财政金融政策协调机制研究参考文献后记

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>