

<<经济分析中的时间序列模型>>

图书基本信息

书名：<<经济分析中的时间序列模型>>

13位ISBN编号：9787310039067

10位ISBN编号：7310039068

出版时间：2012-6

出版时间：南开大学出版社

作者：赵国庆 著

页数：173

字数：290000

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>

## <<经济分析中的时间序列模型>>

### 内容概要

赵国庆编著的《经济分析中的时间序列模型》内容介绍：通过考察经济数据的统计性质把握经济现象背后内在的数据生成过程是经济时间序列分析的主要工作，其目的在于通过对历史数据变化规律的考察提高经济趋势预测的精度。

20世纪70年代Box与Jenkins系统研究了时间序列的建模步骤，奠定了时间序列方法在经济分析中的地位。

众所周知，大多数经济时间序列含有很强的趋势成分，对于趋势的处理与研究一直是时间序列方法发展中重要组成部分。

<<经济分析中的时间序列模型>>

作者简介

赵国庆，1996年获日本京都大学经济学博士，现任中国人民大学经济学院教授、博士生导师。兼任浙江大学教授、日本关西学院大学客座教授、中国数量经济学会常务理事、学术委员。

# <<经济分析中的时间序列模型>>

## 书籍目录

### 第一章 平稳时间序列及性质

- 1.1 经济时间序列的基本概念
- 1.2 AR (Autoregressive) 模型及性质
- 1.3 偏自相关 (partial autocorrelation) 函数
- 1.4 MA (Moving Average) 模型及性质
- 1.5 ARMA (AutoregressiveMovingAverage) 模型及性质
- 1.6 AR (p) 模型的估计
- 1.7 MA (g) 与ARMA模型的估计
- 1.8 平稳时间序列的建模过程

#### 参考文献

### 第二章 单位根与协整分析

- 2.1 单位根与伪回归
- 2.2 AR模型的单位根检验
- 2.3 MA模型的单位根检验
- 2.4 ARIMA模型的单位根检验
- 2.5 向量自回归与误差修正模型
- 2.6 时间趋势与协整关系
- 2.7 协整关系的实证研究

#### 本章附录

#### 参考文献

### 第三章 时间序列的因果性检验

- 3.1 平稳时间序列的Granger因果性检验
- 3.2 协整关系与Granger因果性
- 3.3 非平稳时间序列的Granger因果性检验
- 3.4 蒙特卡洛模拟结果
- 3.5 Granger因果性检验的一些新发展

#### 本章附录

#### 参考文献

### 第四章 通货膨胀预期与Granger因果性

- 4.1 Granger因果性与粮价及通货膨胀之关系
- 4.2 模型的设定与检验
- 4.3 向最误差修证模型的估计

#### 本章附录

#### 参考文献

### 第五章 货币供给与收入间因果性的单位根分析

- 5.1 ARMA模型的设定
- 5.2 ARMA模型的单位根检验
- 5.3 货币供给与收入间的因果性检验
- 5.4 存在滞后阶数与结构变化时的因果性研究
- 5.5 Sims检验与Sims滤波

#### 本章附录

#### 参考文献

### 第六章 货币需求函数与弱外生性检验

- 6.1 非平稳性分析
- 6.2 长期关系的估算

## <<经济分析中的时间序列模型>>

6.3 弱外生性

6.4 货币需求函数的估计

本章附录

参考文献

第七章 货币长期中性与单位根检验

7.1 Fisher与Seater的货币长期中性检验

7.2 中国货币长期中性研究

7.3 日本货币长期中性研究

本章附录

参考文献

第八章 面板数据分析

8.1 面板数据模型

8.2 动态面板数据模型

8.3 基于动态面板模型的实证分析

本章附录

参考文献

附录

A.EViews软件使用手册

B.统计表

<<经济分析中的时间序列模型>>

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>