

<<应用时间序列计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<应用时间序列计量经济学>>

13位ISBN编号：9787111253358

10位ISBN编号：7111253353

出版时间：2008-12

出版时间：机械工业

作者：赫尔穆特·鲁克波尔,马库斯·克莱茨希

页数：251

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>

## <<应用时间序列计量经济学>>

### 前言

2005年9月到2006年5月期间，我受国家留学基金委资助在芬兰赫尔辛基大学经济研究中心(HECER)、经济结构与增长研究所(RUESG)做访问学者。

在这段时间里，我在瑞典经济学院(Swedish School of Economics)旁听了时间序列分析这门课，当时采用的教材是沃尔特-恩德斯(Walter Enders)撰写的《应用计量经济时间序列分析》(Applied Econometrics Time Series)，听过以后总感觉有点意犹未尽，后来我的导师萨科宁·彭蒂(Saikkonen Pentti)教授向我推荐了本书。

本书的应用性、针对性、前沿性很强，其中实例涉及了货币经济学、国际金融学、宏观经济学与金融学等多个领域，对扩大学术视野和掌握研究方法十分有益。

因此，我产生了将本书翻译并介绍给国内读者的想法，目的是让更多的相关研究人员和学生掌握时间序列的分析方法，将其运用于解释与分析相关领域的问题。

## <<应用时间序列计量经济学>>

### 内容概要

本书对20年来时间序列模型的发展及其应用做了一个系统的整理和介绍，以单位根和协整为核心，包括结构向量自回归模型、条件异方差模型、非线性和非参数时间序列模型、平滑转移回归模型等，最后本书还对德国柏林洪堡大学研究开发的多变量时间序列分析软件JMulti进行了简单的介绍。

该书适合作为经济学、金融学和统计学专业硕士研究生和博士研究生的教材，同时也可以作为从事宏观经济建模和金融建模的研究人员的参考书。

<<应用时间序列计量经济学>>

作者简介

赫尔穆特·鲁克波尔（Helmut Lutkepohl），1992～2005年担任德国洪堡大学经济与商务管理学院的计量经济学教授，在此之前他于1987～1992年担任德国基尔大学统计学教授，于1985～1987年担任德国汉堡大学统计学教授，还于1984～1985年担任加利福尼亚大学圣迭戈分校客座助理教授

## &lt;&lt;应用时间序列计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

致中国读者译者序编者简介译者简介前言第1章 基础工作与概述 1.1 引言 1.2 制定经济计量方案 1.3 获取数据 1.4 数据处理 1.5 各章概要第2章 单变量时间序列分析 2.1 时间序列的特征 2.2 平稳性和单整随机过程 2.3 一些常用的时间序列模型 2.4 参数估计 2.5 模型设定 2.6 模型检测 2.7 单位根检验 2.8 单变量时间序列预测 2.9 实例 2.10 本章总结及展望第3章 向量自回归与向量误差修正模型 3.1 引言 3.2 VAR与VECM 3.3 估计 3.4 模型设定 3.5 模型检测 3.6 VAR过程和VECM预测 3.7 格兰杰因果关系分析 3.8 一个实例 3.9 扩展讨论第4章 结构向量自回归建模和脉冲响应 4.1 引言 4.2 模型 4.3 脉冲响应分析 4.4 结构参数估计 4.5 脉冲响应的统计推理 4.6 预测误差方差分解 4.7 实例 4.8 结论第5章 条件异方差 5.1 经验价格过程的典型事实 5.2 单变量GARCH模型 5.3 多变量GARCH模型第6章 平滑转换回归模型 6.1 引言 6.2 模型 6.3 建模过程 6.4 两个经验实例 6.5 最后总结第7章 非参数时间序列模型 7.1 引言 7.2 局部线性估计 7.3 窗宽和滞后项选择 7.4 诊断 7.5 条件波动建模 7.6 局部线性季节模型 7.7 例1：美国平均周工作时间 7.8 例2：XETRA DaX指数第8章 JMulTi软件 8.1 JMulTi介绍 8.2 JMulTi中的数字、日期和变量 8.3 数据集的处理 8.4 选择、转换和创建时间序列 8.5 JMulTi中的变量管理 8.6 为计量经济软件开发者们提供的注意事项 8.7 结论参考文献符号和缩写表

## <<应用时间序列计量经济学>>

### 章节摘录

本书探讨了时间序列计量分析的多种方法。

一般而言，时间序列是一个特定变量在一段时期之内的连续观测值，观测值按时间先后自然排序。

通常，当我们把一系列观测值定义为一个时间序列时，我们都假定观测频率具有一定的规律性。

例如，在为期30年的期限内，每年得到一个观测值。

更为具体的实例是，比如考虑某国1970 - 1999年这段期间内的年度国民生产总值(GNP)。

当然，观测频率可以比年度更高一些，比如，可以获取某一特定时期内每个季度、每个月度甚至每一天的观测值。

目前我们甚至可以得到股票价格或其他金融市场变量的高频时间序列，它可以具体到很短的几分或几秒。

可以利用时间序列数据来分析很多经济问题，比如很多宏观计量分析基于时间序列数据。

在宏观经济计量分析中，其中一个重要目标在于预测未来经济环境，而另外一个重要目标是要理解一系列可能相关变量间的关系，或者发现经济系统或某一特定市场的发展动态。

## <<应用时间序列计量经济学>>

### 媒体关注与评论

为现有时间序列模型的应用提供了一个清晰、细致的指南，不仅如此，本书还提供了完整的应用程序，因此任何具有时间序列计量经济学基础的学生和应用经济学家都可以很快学会如何成功地进行应用时间序列分析。

我们等待这样一本关于应用时间序列的教材已经有很长一段时间了，因此我相信本书一定会很受欢迎。

——2003年诺贝尔经济学获奖者、计量经济学家 克莱夫·格兰杰 《应用时间序列计量经济学》纵览了应用于宏观经济和金融时间序列分析的现代计量分析模型，该书不仅讨论了现在主流的时间序列问题，比如说单位根、协整以及自回归条件异方差模型等，还讨论了很多前沿的时间序列问题，比如说非线性和非参数的时间序列模型等。

就像书名所提示的一样，该书对这些模型的应用提供了一个简明扼要但清晰的展示，因此《应用时间序列计量经济学》非常适合作为从事应用时间序列分析人士的参考书，当然它也可以作为高年级和研究生应用计量经济学课程的教学参考书。

——阿姆斯特丹大学经济学教授 彼得·博斯克

## <<应用时间序列计量经济学>>

### 名人推荐

《应用时间序列计量经济学》为现有时间序列模型的应用提供了一个清晰、细致的指南，不仅如此，本书还提供了完整的应用程序，因此任何具有时间序列计量经济学基础的学生和应用经济学家都可以很快学会如何成功地进行应用时间序列分析。

我们等待这样一本关于应用时间序列的教材已经有很长一段时间了，因此我相信本书一定会很受欢迎。

——经济学奖获得者、计量经济学家 克莱夫·格兰杰(Clive W.J.Granger) 《应用时间序列计量经济学》纵览了应用于宏观经济和金融时间序列分析的现代计量分析模型，该书不仅讨论了现在主流的时间序列问题，比如说单位根，协整以及自回归条件异方差模型等，还讨论了很多前沿的时间序列问题，比如说非线性和非参数的时间序列模型等。

就像书名所提示的一样，该书对这些模型的应用提供了一个简明扼要但清晰的展示，因此《应用时间序列计量经济学》非常适合作为从事应用时间序列分析人士的参考书，当然它也可以作为高年级和研究生应用计量经济学课程的教学参考书。

——阿姆斯特丹大学经济学教授彼得·博斯克(Peter Boswijk)



<<应用时间序列计量经济学>>

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>