第一图书网, tushu007.com

<<计量经济学软件EViews6.0>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学软件EViews6.0建模方法与操作技巧>>

13位ISBN编号：9787111343325

10位ISBN编号：7111343328

出版时间：2011-6

出版时间：机械工业

作者：刘巍//陈昭

页数：162

字数：198000

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

内容概要

刘巍等编著的《计量经济学软件EViews6.0建模方法与操作技巧》介绍了近几年前沿的计量模型的应用技巧和EViews
6.0软件操作方法，内容主要包括：高频数据和低频数据的相互转换——频率转换；变量在滞后时间上的动态影响——VAR模型、VEC模型、脉冲响应与方差分解；季节与节假日对数据影响的处理方法——季节调整；经济数据规律性分析方法——周期与滤波；处理数据复杂性异方差的广义自回归条件导方差——GARCH族模型；个别情况需要使用到的特殊建模方法——二元选择模型（Tobit、Probit和Logit）、非线性模型（逻辑斯蒂曲线）；对模型结果的检验和判断——模型的诊断与检验（Chow检验、RESET检验、CUSUM检验和平方的
CUSUM检验、一步预测检验和N步预测检验、协整检验的EG检验、Mackinnon
检验）；变量的交互作用与相互影响模型——联立方程模型的设定与估计；面板模型以及非平稳面板的建模方法和技巧——一般面板模型、面板单位根与协整。

《计量经济学软件EViews6.0建模方法与操作技巧》适合硕士研究生及以上层次人员使用，包括各高校教师以及研究机构人员。

作者简介

刘巍，男，1960年生，黑龙江省哈尔滨市人，历史学硕士，经济学博士。
现任广东外语外贸大学中国计量经济史研究中心主任、教授，中国数量经济学会常务理事，中国经济史学会现代经济史分会理事，广东省经济学会中青年委员会副秘书长，广东省金融学会常务理事。
著有：《经济发展中的货币需求》、《宏观经济运行中的货币》等专著7部。

主要研究方向为货币经济学、计量经济史学。

陈昭，男，1972年出生，黑龙江庆安人。
经济学博士、教授，广东外语外贸大学中国计量经济史研究中心副主任，中国数量经济学会会员，国内核心期刊匿名审稿人。

主要研究领域：货币理论、宏观经济、动态非稳定面板、计量经济史学。

电子邮箱：chenzhao2002@mail.gdufs.edu.cn

书籍目录

序
第一章 VAR模型、脉冲响应与方差分解、VEC模型
 第一节 VAR模型
 第二节 脉冲响应与方差分解
 第三节 VEC模型
第二章 GARCH族模型的估计
 第一节 ARCH模型
 第二节 GARCH模型
 第三节 EGARCH模型
 第四节 PARCH模型
 第五节 GARCH组合模型
第三章 频率转换、季节调整、周期与滤波
 第一节 频率转换
 第二节 季节调整
 第三节 周期与滤波
第四章 二元选择模型与逻辑斯蒂曲线模型
 第一节 二元选择模型
 第二节 逻辑斯蒂曲线模型
第五章 模型的诊断与检验
 第一节 设定检验和稳定性检验
 第二节 递归残差检验
 第三节 协整关系的后验检验
第六章 联立方程模型
第七章 一般面板模型
第八章 面板单位根检验、面板协整检验与面板格兰杰因果检验
 第一节 面板单位根检验
 第二节 面板协整检验
 第三节 面板格兰杰因果检验
附录
 附录A 第一章VAR模型、第二章GARCH族模型所用数据
 附录B 第三章频率转换、季节调整、周期与滤波所用数据
 附录C 面板模型所用数据
后记

章节摘录

版权页：插图：

编辑推荐

《计量经济学软件EViews6.0建模方法与操作技巧》是由机械工业出版社出版的。

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