

<<非线性阈值协整理论及其在中国的应>>

图书基本信息

书名：<<非线性阈值协整理论及其在中国的应用研究>>

13位ISBN编号：9787500491613

10位ISBN编号：7500491611

出版时间：2010-11

出版时间：中国社会科学出版社

作者：欧阳志刚

页数：302

字数：250000

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>

<<非线性阈值协整理论及其在中国的应>>

内容概要

《非线性阈值协整理论及其在中国的应用研究》基于实际经济背景和现实数据特征，特别是我国宏观经济结构的动态变化特征，针对现有阈值协整理论文献的不足而进行扩展和改进，并应用相关方法实证研究我国重要的现实经济问题。

书籍目录

关于协整和阈值协整的札记(代为序)

第一章 引言

第一节 问题的提出

第二节 阈值协整的定义

第二章 现有阈值协整研究文献综述

第一节 基于残差单位根检验的阈值协整研究

第二节 基于VECM的阈值协整估计与检验方法

第三节 基于非线性协整关系的阈值协整检验综述

第三章 STR—ECM模型的检验与估计方法

第一节 协整向量已知的STR—ECM模型的检验与估计方法

第二节 协整向量未知的STR—ECM模型的估计与检验方法

第三节 案例研究——中国利率的非线性动态调节及其货币政策效果

第四节 研究小结

第四章 协整向量机制转移的阈值协整检验与估计方法

第一节 协整平滑转移回归模型中的线性检验

第二节 平滑转移回归模型中的协整检验与估计方法

第三节 案例研究——中国经济周期中菲利普斯曲线机制转移的阈值协整研究

第四节 研究小结

第五章 协整向量机制转移的面板阈值协整的估计与检验方法

第一节 不含阈值效应的面板协整检验

第二节 阈值面板协整检验

第三节 阈值面板协整检验统计量的有限样本性质

第四节 案例研究——农民医疗卫生支出影响因素的面板协整分析

第五节 研究小结

第六章 中国城乡收入差距对经济增长的效应

第一节 引言

第二节 收入差距与经济增长关系的文献综述

第三节 中国城乡收入差距的度量

第四节 中国城乡收入差距对经济增长的效应

第五节 研究小结

第七章 总结与说明

附录 主要仿真、估计和检验程序

参考文献

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>