

<<单位根检验程序的改进研究>>

图书基本信息

书名：<<单位根检验程序的改进研究>>

13位ISBN编号：9787810885430

10位ISBN编号：781088543X

出版时间：2006-8

出版时间：西南财经大学出版社

作者：靳庭良

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>

<<单位根检验程序的改进研究>>

内容概要

单位根检验是研究经济和金融时间序列平稳性的一种基本方法，也是变量之间协整检验、因果关系检验以及建立ARMA模型或ARIMA模型的基础工作。

利用现成的软件，常用的单位根检验-ADF（DF）检验和PP检验-更是被方便地用于实证分析，就其简单的检验程序和易操作性，称之为“傻瓜检验法”并不过分。

这些检验可靠吗? 其检验结果是否会给人们带来误导？

ADF（DF）检验与PP检验那一种更可靠？

它们的适用范围如何？

如何合理设定原假设、选择检验式？

如何改进已有的检验程序，从根本上解决检验水平的扭曲问题，以大幅提高单位根检验的可靠性？

对这些问题，国内外学者尚无人给出令人满意的答案。

笔者在分析已有相关研究在试验设计及检验程序中存在的缺陷的基础上，从改进模拟试验方法入手，系统研究了单位根检验中存在的问题并给了切实可行的解决方法。

<<单位根检验程序的改进研究>>

书籍目录

前言摘要Abstract1 绪论 1.1 研究背景 1.2 单位根检验稳健性和可靠性研究存在的问题 1.3 进一步研究ADF (DF) 和PP检验可靠性的意义 1.4 研究思考及研究方法 1.5 本书结构及创新之处2 DF单位根检验的势及检验式的选择 导言 2.1 DF单位根检验概述 2.2 Monte Carlo模拟试验设计 2.3 DF检验的可靠性研究(一) 2.4 DF检验的可靠性研究(二) 2.5 DF检验程序的改进 2.6 小结3 具有GARCH (1, 1) - Normal-errors的单位过程DF检验的可靠性研究之一 导言 3.1 ARCH/GARCH 模型评述 3.2 试验设计 3.3 GARCH-Normal-errors对DF检验稳健性的影响 3.4 具有GARCH-Normal-errors的单位根过程DF检验的势函数 3.5 F检验与k,T检验可靠性的比较 3.6 小结4 具有GARCH (1, 1) -Normal-errors的单位根过程DF检验的可靠性研究之二 导言 4.1 GARCH效应对检验式含有截距项和趋势项的DF检验的影响 4.2 GARCH效应对检验式不含截距项和趋势项的DF检验的影响 4.3 GARCH效应对情形3中DF检验的影响 4.4 小结5 其他GARCH类误差项对DF检验的影响6 ADF检验的稳健性和可靠性研究7 PP检验的稳健性和可靠性研究8 单位根检验原假设的设定及其应用研究参考文献附录一 Di ckey-Faller检验的临界值表附录二 蒙特卡罗模拟试验的matlab程序精选附录三 泛函中心极限定理 (Functional Central Limit Theorem) 后记

<<单位根检验程序的改进研究>>

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>