第一图书网, tushu007.com

<<格兰杰计量经济学文集（全2卷）>>

图书基本信息

书名：<<格兰杰计量经济学文集（全2卷）>>

13位ISBN编号：9787810989404

10位ISBN编号：7810989405

出版时间：2007-12-1

出版时间：上海财经大学出版社

作者：格兰杰

页数：866

译者：朱小斌

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

格兰杰是最具创造力的现代计量经济学家之一，他对帮助我们理解因果关系、建模方法、非平稳性、季节性和预测做出了重要的贡献。
一些被广泛应用的时间序列计量经济学概念就来自于他的研究成果，这是因为格兰杰善于将观测到的经济结果系统地用模型来表述，而且这些模型很好地反映了经济体复杂和进化的本质，这本书收录了他发表过的作品，而且把主要主题下相关联的研究集合到一起，这样便更容易找到相关的论文，里面的很多文章值得我们认真反复研读。

作者简介

克莱夫.W.J.格兰杰，世界上最伟大的计量经济学家之一。
瑞典皇家科学院在颁奖词中说：“ 他不仅是研究员们学习的光辉典范，而且是金融分析家的楷模。”他在利用数学模型分析时间序列数据方面的实证研究，给全世界打开了一扇窥探经济运行规律，特别是金融市场运行规律的大门。
他的众多开创性想法和洞见深刻地影响了统计学、计量经济学和动态经济学理论的发展。

书籍目录

译者序致谢贡献者内容简介（第一卷） 第一章 《计量经济学理论》杂志对格兰杰教授的访谈 第一部分 谱分析 第二章 对纽约股市价格指数的谱分析 第三章 一个经济变量的典型谱形 第二部分 季节性 第四章 季节性：原因、解释及涵义 第五章 季节调整是线性还是非线性数据过滤过程 第三部分 非线性 第六章 非线性时间序列建模 第七章 利用相关指数来决定一个经济序列是否混沌 第八章 检验时间序列模型中被忽视的非线性性——神经网络方法与其他方法的比较 第九章 扩展记忆变量之间的非线性建模 第十章 天气与电力销售之间关系的半参数估计 第四部分 方法论 第十一章 时间序列模型及其解释 第十二章 时间序列模型的可逆性 第十三章 接近正态性以及一些计量经济模型 第十四章 构造计量经济模型的时间序列方法 第十五章 对政策模型评估的若干建议 第十六章 共同因素聚合的含义 第五部分 预测 第十七章 潮河泛滥的概率估计 第十八章 运用广义误差成本函数进行预测 第十九章 对经济预测评估的若干建议 第二十章 复合预测 第二十一章 邀请综述：复合预测——二十年后 第二十二章 变权数复合预测 第二十三章 变换序列预测 第二十四章 白噪声预测 第二十五章 我们可以改善经济预测的质量吗 第二十六章 电力负荷及其峰值的短期预测内容简介(第二卷) 第一部分 因果关系 第一章 通过计量经济学模型和交叉谱方法来研究因果关系 第二章 因果关系检验：个人观点 第三章 因果关系概念的一些新发展 第四章 广告与总消费：一个因果关系研究 第二部分 单整和协整 第五章 计量经济学中的伪回归 第六章 时间序列数据的性质及其在计量经济学模型设定中的应用 第七章 误差修正模型的时间序列分析 第八章 协整与误差修正：表示、估计和检验 第九章 协整经济变量研究的发展 第十章 季节性单整和协整 第十一章 短期国库券收益率的协整分析 第十二章 协整系统中共同长期记忆分量的估计 第十三章 协整系统的分离和“持久一短暂”分解 第十四章 单整时间序列的非线性变换 第十五章 带有吸引子的长期记忆序列 第十六章 协整变量的新近发展 第三部分 长期记忆 第十七章 长期记忆时间序列模型及分数差分介绍 第十八章 长期记忆关系与动态方程的结合 第十九章 股票市场收益的长期记忆性质及一个新模型

章节摘录

谱方法　　在第一章“《计量经济学理论》杂志对格兰杰教授的访谈”中，Granger教授提到，由于他当时是诺丁汉大学惟一一名统计学家，所以他碰到了来自不同学科的各种各样的统计问题。
Granger在诺丁汉大学获得了统计学博士学位并在那里任教多年。
这些使得他早期发表的那些文章大多不是经济学领域的。
实际上我们这套文集的第二卷就有一篇他早期的关于水文学方面的文章。
Granger最早在时间序列计量经济学方面的工作是与Michio Hatanaka一起进行合作研究时开始的。
后来在其普林斯顿的导师Oskar Morgenstern指导以及John Tukey的带领下，他的研究工作进展很快。
Cramer（1942）最早提出了弱平稳过程的谱分解，并在20世纪50年代和60年代早期在谱分析领域注入了满腔热情。
那个时期许多一流的学者，包括Milton Friedman、John von Neumann和Oskar Morgen—stern，都看到了傅立叶分析在经济数据中的广阔应用前景。
1964年，普林斯顿出版社出版了Granger和Hatanaka的专著，这是在经济时间序列分析领域的第一本系统、严密地论述谱分析的著作。
谱方法有一个很吸引人的性质就是它不要求模型的具体形式，就能直接从平稳假设中导出分析结论。
有趣的是，这本书直到出版了三十多年以后，才成为这个领域重要的参考文献。
　　Granger和Hatanaka的工作在很多学术研究领域产生了重要的影响。
关于商业周期波动这个概念的讨论在时间序列分析领域持续了很长时间。
谱分析则为其提供了一个新工具，并在这个领域得出了重要的新观点。
今天，宏观经济学家经常提到的商业周期频率（这是商业周期分析中最基础的一个概念）就是运用了频域分析的方法。
实际上，宏观经济学的高级教科书，如Sargent（1987），都有一整章专门论述谱分析。
大多数经济时间序列的谱有一个最重要的性质，即大部分的力量（影响因素）都是低频的。
现实中不存在所谓单一的商业周期的顶峰，而是在一个4～8年的长周期里有很多中等规模的峰。

第一图书网, tushu007.com

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