

<<高级计量经济学及Stata应用>>

图书基本信息

书名：<<高级计量经济学及Stata应用>>

13位ISBN编号：9787040301816

10位ISBN编号：7040301814

出版时间：2010-1

出版范围：高等教育

作者：陈强

页数：404

字数：630000

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>

## &lt;&lt;高级计量经济学及Stata应用&gt;&gt;

## 前言

本书是在山东大学经济学院硕士生、博士生《高级计量经济学》教案的基础上编著而成，适合高等学校经济管理类或社科类研究生与研究人员使用。

本书的主要特色如下：（1）接轨现代计量经济学。

本书较多地借鉴了Baur (2006)，Cameron and Trivedi (2005,2009)，Greene (2003)，Hamilton (1994)，Hayashi (2000)，Kennedy (2003)，Poirier (1995)，Verbeek (2004)，Wooldridge (2001)，其中尤以Hayashi (2000)对本书的影响最深。

（2）内容全面。

除了介绍传统的横截面数据外，本书对面板数据（含长面板、动态面板）、时间序列（含VAR、单位根、协整）、自然实验、重复截面数据、GMM、蒙特卡罗法、自助法、分位数回归、门限回归、非参数估计、贝叶斯估计等方法均进行了较深入的介绍。

（3）计量理论与软件操作相结合。

学习计量的学生，既需要了解计量原理，也需要知道如何在电脑上实现。

为此，本书提供了“一站式”服务，在讲解每个估计方法后，随即介绍相应的Stata电脑操作及实例（Stata为目前欧美最为流行的计量软件）。

（4）本书力图以生动的语言、较多的插图与经济意义来直观地解释计量方法，而不仅仅是从数学推导到数学推导；另一方面，又不失数学的严谨性（部分证明放在附录）。

（5）先修课不包括本科水平的计量经济学。

在中国的国情下，不少经济类研究生并未学过本科阶段的计量经济学。

因此，本书在内容安排上，假设读者已经学过微积分、线性代数与概率统计，但不要求学过本科阶段的计量经济学（当然，如果学过更好）。

学习计量经济学不是一件容易的事（我也经历过，以后还要经历），但回报却很丰厚（其为实证研究不可或缺之工具），可以说是“高投入、高产出”。

对于许多初学者而言，或许计量经济学难就难在使用了较多的数学。

但数学只是一种语言，而任何数学符号原则上都可以“翻译”为汉语。

事实上，看似复杂的数学公式后面，常常有着非常直观的道理。

因此，只要渐渐地掌握数学这门语言，学会看数学符号背后的含义，学习计量也就不难了。

套用禅的一个故事，学习计量大致可以分为三个境界。

第一境界是“见山是山，见水是水”，第二境界是“见山不是山，见水不是水”，第三境界是“见山又是山，见水又是水”。

在第一阶段，以为计量就是作最小二乘回归而已，自然不在话下。

在第二阶段，开始体会到计量的精妙之处，心中时时产生疑问。

在第三阶段，通过考前复习及实践应用，对计量的理论与方法逐渐融会贯通，进而内化为熟练掌握的工具。

其中，尤以第二阶段最为漫长。

“取法乎上，仅得其中”。

貌似难懂之处，其实正是取得进步的地方。

这是一个“痛并快乐着”的过程，时常伴有顿悟之喜悦。

我曾为学生们写了一首打油诗，收录在此，以博一笑。

## <<高级计量经济学及Stata应用>>

### 内容概要

陈强编写的《高级计量经济学及Stata应用》较多地借鉴了现代计量经济学的最新发展，其内容全面，除了介绍传统的横截面数据外，对面板数据(含长面板、动态面板)、时间序列(含VAR、单位根、协整)、自然实验、重复截面数据、GMM、蒙特卡罗法、自助法、分位数回归、门限回归、非参数估计、贝叶斯估计等方法均做了较深入的介绍。本书力图以生动的语言、较多的插图与经济意义来直观地解释计量方法，而又不失数学的严谨性。结合目前欧美最为流行的Stata计量软件，及时地介绍相应的Stata命令与实例，为读者提供“一站式”服务。

《高级计量经济学及Stata应用》适合普通高等学校经济管理类或社科类硕士生、博士生与研究人员使用。

为便于读者学习高级计量经济学，《高级计量经济学及Stata应用》在内容安排上，假设读者已经学过微积分、线性代数与概率统计，但不要求学过本科阶段的计量经济学。

## 作者简介

陈强，分别于1992年与1995年获北京大学经济学学士与硕士学位，2007年获Northern Illinois University数学硕士与经济学博士学位，现任山东大学经济学院副教授。

已发表论文于Journal of Comparative

Economics、《世界经济》等国内外期刊，并曾获中国数量经济学会、中国制度经济学会优秀论文奖。

主要研究领域为宏观经济学、计量经济学与制度经济学。

书籍目录

- 第1章 绪论
- 第2章 概率统计回顾
- 第3章 小样本OLS
- 第4章 Stata简介
- 第5章 大样本OLS
- 第6章 最大似然估计法
- 第7章 异方差与GLS
- 第8章 自相关
- 第9章 模型设定与数据问题
- 第10章 工具变量, 2SLS与GMM
- 第11章 短面板
- 第12章 长面板与动态面板
- 第13章 离散被解释变量
- 第14章 受限被解释变量
- 第15章 随机实验与自然实验
- 第16章 蒙特卡罗法与自助法
- 第17章 平稳时间序列
- 第18章 单位根与协整
- 第19章 自回归条件异方差模型
- 第20章 似不相关回归
- 第21章 联立方程模型
- 第22章 非线性回归与门限回归
- 第23章 分位数回归
- 第24章 非参数与半参数估计
- 第25章 贝叶斯估计简介
- 第26章 如何做规范的实证研究
- 附录：常用数据来源
- 参考书目
- 主题索引
- 数学符号
- 英文缩写

章节摘录

版权页：插图：对于刚开始进行研究的人来说，常常不知该如何选择研究课题。研究者通常知道自己想要研究的领域（比如，经济增长），但这还不是一个具体的研究问题（research question）。

对实证分析而言，研究问题通常是有关“x对y有何作用”之类的问题。

如果想研究“金融发展对经济增长的作用”，就更具体了，此处x指的是“金融发展”（可以包含多个变量），而少指的是“经济增长”。

研究问题可以来源于理论（比如，检验资产定价模型CAPM是否成立），也可以来自对经济现象的观察（比如，媒体的热点问题报道，社会调研），可以研究某个政策的效应（比如，新劳动法对失业率的影响），也可以对文献中已有论文进行改进。

提出好的研究问题，也许你的研究就成功了一半。

什么是好的研究问题呢？

总的来说，研究问题越具体、越有趣、越新颖、越有可行性，则越好！

（1）具体：简单来说，在以上“x对y有何作用”这样的句型中，应能明确x与y具体是什么。

（2）有趣：你研究的问题别人会感兴趣吗？

为什么我们要在乎你的问题（Why should we care）？

知道你的问题的答案后，能影响人们对世界的某个方面的看法吗？

你的研究问题为什么重要？

（3）新颖：论文的核心价值在于它的创新性，即做出了文献中所没有的边际贡献。

这种边际贡献可以是研究了新的现象、使用了新的（更好的）计量方法、或使用了新的数据集。

做研究的过程是创造新知识的过程，在本质上不同于学习已有（旧）知识的过程。

（4）可行：即使你的研究问题很具体、很有趣、很新颖，如果找不到相应的数据，则不可行。

有了潜在的研究问题后，就可以进行初步的探索性研究（exploratory study），看看它是否满足以上标准。

比如，通过查文献，看别人是否已经做过类似的研究，或大致了解数据是否可得。

显然，备选的研究问题或想法越多越好，因为能“存活”下来的课题通常不多。

编辑推荐

《高级计量经济学及Stata应用》是在山东大学经济学院硕士生、博士生《高级计量经济学》教案的基础上编著而成，适合高等学校经济管理类或社科类研究生与研究人员使用。本书内容全面，除了介绍传统的横截面数据外，对面板数据（含长面板、动态面板）、时间序列（含VAR、单位根、协整）、自然实验、重复截面数据、GMM、蒙特卡罗法、自助法、分位数回归、门限回归、非参数估计、贝叶斯估计等方法均进行了较深入的介绍。

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>