

<<面板数据计量经济分析>>

图书基本信息

书名：<<面板数据计量经济分析>>

13位ISBN编号：9787111302308

10位ISBN编号：7111302303

出版时间：2010-5

出版时间：机械工业出版社

作者：巴蒂·H. 巴尔塔基(Badi H. Baltagi)

页数：280

译者：白仲林

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>

<<面板数据计量经济分析>>

前言

2004年我托朋友从澳大利亚带回来一本《面板数据计量经济分析》（第2版），经过仔细阅读发现该书基础理论知识完整、经验应用内容充实，更值得一提的是系统地概述了面板数据计量经济学研究的前沿。

2006年秋季，在南开大学数量经济研究所张晓峒教授的指示下，开设面板数据专题讨论班。

我与南开大学数量经济研究所的博士、硕士们一起研读巴尔塔基教授的这部学术著作。

参加讨论的有2008届硕士和2009届博士。

在为期一年的讨论学习基础上，王健博士（第11章）、攸频博士（第9章）、栾惠德博士（第4章）、赵娜博士（第3章）、魏学辉博士（第1、2和第8章）、郑妍妍博士（第7章）、刘雪艳博士（第7章）、邓露博士（第6章）和我（第5、10和第12章）合作完成了该书第2版的译稿。

但是，在2008年准备联系出版译著时，巴尔塔基教授出版了本书的第4版。

于是，在第2版译稿的基础上，我们又翻译了第4版，这次李树生博士和段鹏博士也参加了第4版的翻译。

之后，我对全部译稿进行了统一梳理和编纂，张晓峒教授仔细审阅了全部译稿。

回顾从第2版、第3版到第4版的学习和翻译过程，我们深感巴尔塔基教授的这部专著具有深入浅出、系统全面和循循善诱的特色。

本书不仅是面板数据计量分析课程的一部优秀教材，也是面板数据计量经济学理论及其应用研究者的一部适用工具书。

另外，在这期间，我们得到了国家自然科学基金委的大力支持，本学术专著的翻译也是国家自然科学基金资助项目（项目批准号：70771072、70571039）的阶段成果之一。

白仲林于天津财经大学振财里

<<面板数据计量经济分析>>

内容概要

面板数据计量经济分析已经成为计量经济学研究的重要分支之一，本书系统介绍了面板数据模型的理论方法和应用，其内容包括静态、动态面板数据模型的设定、估计、检验和应用。

尤其是对于非经典（非平稳）面板数据的计量经济分析方法的系统介绍是本书的特色之一。

其次，本书还集中讨论了受限因变量面板数据模型、非平衡面板数据模型和面板数据联立方程模型的技术方法，指出了面板数据计量经济分析的发展方向。

本书适合高等院校经济学类本科生、研究生使用。

<<面板数据计量经济分析>>

作者简介

巴蒂 H.巴尔塔基，自1979年在宾夕法尼亚大学获得经济学博士学位以来，巴蒂 H.巴尔塔基先后在美国休斯敦大学和得克萨斯A&M 大学任教。

曾出版了《面板数据计量经济分析》和《计量经济学》等学术专著，编辑出版了《理论计量经济精粹》、《面板数据计量经济学新进展》（卷I和卷

<<面板数据计量经济分析>>

书籍目录

译者序 作者简介 前言 教学建议 第1章 导论 1.1 面板数据：一些例子 1.2 为什么使用面板数据，它们的优点和局限性 注释 第2章 单因素误差回归模型 2.1 介绍 2.2 固定效应模型 2.3 随机效应模型 2.4 极大似然估计 2.5 预测 2.6 案例 2.7 精选的应用案例 2.8 计算的注意事项 注释 本章习题 第3章 双因素误差回归模型 3.1 简介 3.2 固定效应模型 3.3 随机效应模型 3.4 极大似然估计 3.5 预测 3.6 案例 3.7 应用精选 注释 本章习题 第4章 面板数据的假设检验 4.1 面板数据的混合估计检验 4.2 对个体效应和时间效应的检验 4.3 Hausman设定检验 4.4 进一步阅读 注释 本章习题 第5章 单因素误差模型中的异方差和序列相关 5.1 异方差 5.2 序列相关 注释 本章习题 第6章 因素误差的似不相关回归模型 6.1 单因素误差模型 6.2 双因素误差模型 6.3 应用与扩展 本章习题 第7章 单因素误差的联立方程组 7.1 单方程的估计 7.2 经验案例：北卡罗来纳州的犯罪 7.3 系统估计 7.4 Hausman和Taylor估计量 7.5 实证分析：PSID数据的收入方程 7.6 进一步阅读以及扩展 注释 本章习题 第8章 动态面板数据模型 第9章 非平衡面板数据模型 第10章 专题 第11章 限值因变量与面板数据 第12章 非平稳面板 参考文献

<<面板数据计量经济分析>>

章节摘录

插图：NLS通过调查记录了几组男性和女性在不同时间点的劳动力市场行为以及其他重大生活事件的相关信息：（1）NLSY97，该组包括从全国抽取的近9 000个青少年，他们1997年时年龄都在12-17岁之间。

（2）NLSY79，该组包括从全国抽取的12 686个年轻男性和女性，他们1979年时年龄在14~22岁之间。直到1994年对这组人一直是一年调查一次，最近改为两年调查一次。

（3）NLSY79儿童和成人组，这组是由NLSY79中女性所生育的子女组成。

（4）成熟女性和年轻女性组，该组包括5 083名1967年时年龄在30-44岁之间的女性，以及1968年时5 159名年龄在14-24岁之间的女性。

对这组人一直是两年调查一次。

（5）老年和青年男性组，该组包括5020名1966年时年龄在45-59岁之间的男性，以及5225名1966年时年龄在14-24岁之间的男性。

对这两部分人的调查在1981年时停止了。

NLS数据集中的变量主要包括学习经历和工作经历，婚姻和子女状况，培训支出，儿童保育支出以及毒品和酒的使用量等。

大量的研究用到了NLS和PSID数据库。

NLS网站还专门为使用了NLS数据库的3 000多篇文章、专著以及工作论文提供搜索服务。

据Brown, Duncan和Stafford（1996）估计，大约有900篇使用了PSID数据库的期刊论文和书籍出版。

PSID的应用范围较广，包括跨期劳动力供给模型；经济周期变化中的工资与就业；失业、工作变换和劳动力流动；消费、收入和资产负债表的动态变化；家庭的延续行为；贫困、福利和收入的动态变化；经济状况的代际传递；经济或人口事件的原因。

由当前人口调查（current population survey, CPS）项目所得到数据也可以建立面板数据集。

CPS是由劳动统计局的人口普查处对全国近50 000个家庭进行的月度调查项目。

该调查项目已经进行了50多年，它是了解美国劳动力特征的主要信息来源。

与NLS和PSID相比，CPS中包含的变量少，时期数也短，而且没有跟踪样本中的迁移人口。

但是，CPS涵盖的样本范围大，因此对所有的群体都具有代表性。

CPS提供对就业、失业、收入、工作时间以及其他一些指标的估计，从中还可以了解年龄、性别、种族、婚姻状况以及受教育程度等人口特征，另外还有职业、行业以及劳动力类型等特征。

另外一个发展中国家家庭调查数据的重要来源是1980年建立的世界银行生活标准测量研究（LSMS）数据集。

自从1985年以来，LSMS已经在阿尔巴尼亚、越南等近20个发展中国家进行了调查。

这些调查大都是2 000-5 000个家庭的小样本，在有的国家调查了一次，在有的国家调查了多次。

在另外一些国家可能是2-4年的面板。

调查问卷有3种类型：家庭、社区和价格问卷，有时也加入学校或健康设施问卷表。

LSMS主要集中在有关贫困本质的规律性上。

像LSMS这种重复调查所得的数据，尽管不是真正意义上的面板数据，但也可以用来构造伪面板数据，参见第10章。

尽管美国的面板数据库在20世纪60年代已经出现，但直到20世纪80年代欧洲才建立了自己的面板数据

。1989年，《欧洲经济评论》（European Economic Review）专门有一期刊发了使用德国社会经济面板数据、瑞典家庭市场和非市场行为研究数据以及荷兰家庭面板数据的一些文章。

德国社会经济面板数据库（german socio-economic panel, GSOEP）的第一次数据搜集是柏林德国经济研究所（DIW）在1984年进行的，其中包括了5 921个联邦德国家庭，总共12290个被调查者。

<<面板数据计量经济分析>>

媒体关注与评论

<<面板数据计量经济分析>>

编辑推荐

<<面板数据计量经济分析>>

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>