

<<高级应用计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<高级应用计量经济学>>

13位ISBN编号：9787302278412

10位ISBN编号：7302278415

出版时间：2012-2

出版时间：清华大学

作者：李子奈//叶阿忠

页数：252

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>

## <<高级应用计量经济学>>

### 内容概要

《清华经济学系列教材：高级应用计量经济学》是一本专门为一个学期的研究生高级计量经济学课程编著的教科书，内容全面，简明扼要，思路清晰，突出应用。

《清华经济学系列教材：高级应用计量经济学》涵盖现代计量经济学模型的所有分支，包括现代时间序列分析模型、微观计量模型、面板数据模型、非参数模型和空间计量模型，以及适用的估计方法，包括最大似然估计、广义矩估计和分位数回归估计等；突出各类模型的适用对象、建模思路和应用中常见问题的诠释，淡化理论方法的数学推导和证明。

《清华经济学系列教材：高级应用计量经济学》既是经济学、管理学硕士研究生和非计量经济学专业博士研究生学习现代计量经济学的适用教材，也是进行现代计量经济学应用研究的基础参考书。

## <<高级应用计量经济学>>

### 作者简介

李子奈，清华大学经济管理学院教授、国家重点学科（数量经济学）负责人、国家精品课程（计量经济学）主讲教授。

曾任清华大学经济管理学院副院长、经济系主任、中国经济研究中心联执主任。

主要学术兼职包括教育部经济类学科教学指导委员会委员、中国数量经济学会副理事长兼高等院校专门委员会主任、北京经济学总会副会长等。

出版计量经济学领域专著和教科书《计量经济学模型方法论》、《计量经济学——方法与应用》、《计量经济学》（第1、2、3版）和《高等计量经济学》。

叶阿忠，经济学博士，福州大学管理学院教授。

兼任中国数量经济学会常务理事。

出版计量经济学领域专著和教科书《非参数和半参数计量经济模型理论》、《非参数计量经济学》和《高等计量经济学》等。

## 书籍目录

第1章 绪论1.1 计量经济学应用研究的若干方法论问题1.1.1 问题提出1.1.2 计量经济学模型的检验功能与发现功能1.1.3 计量经济学模型的归纳推理与演绎推理1.1.4 计量经济学应用研究的总体回归模型设定1.1.5 计量经济学应用模型对数据的依赖性1.2 现代计量经济学内容体系1.2.1 引言1.2.2 经典计量经济学模型的基础地位1.2.3 基于计量经济学模型的数学基础而发展的现代时间序列计量经济学1.2.4 基于研究对象和数据特征而发展的微观计量经济学1.2.5 基于充分利用数据信息而发展的面板数据计量经济学1.2.6 基于非设定的结构关系而发展的非参数计量经济学1.2.7 现代计量经济学模型体系的分解与综合1.3 本章思考题与练习题1.3.1 思考题1.3.2 练习题第2章 非经典计量经济学模型估计方法2.1 最大似然估计2.1.1 最大似然原理2.1.2 线性模型的最大似然估计2.1.3 非线性模型的最大似然估计2.1.4 异方差和序列相关的最大似然估计2.1.5 最大似然估计下的Wald、LM和LR检验2.2 广义矩估计2.2.1 概述2.2.2 广义矩估计及其性质2.2.3 正交性条件和过度识别限制的检验2.2.4 关于2SLS与GMM关系的讨论\*2.3 贝叶斯估计2.3.1 贝叶斯估计2.3.2 线性单方程计量经济学模型的贝叶斯估计2.3.3 一个贝叶斯估计的实例\*2.4 分位数回归估计2.4.1 分位数回归的提出2.4.2 分位数回归及其估计2.4.3 分位数回归的假设检验2.4.4 实例2.5 本章思考题与练习题2.5.1 思考题2.5.2 练习题第3章 现代时间序列计量经济学模型3.1 时间序列的平稳性与单位根检验3.1.1 时间序列数据的平稳性3.1.2 单整时间序列3.1.3 平稳性的单位根检验3.1.4 趋势平稳与差分平稳随机过程\*3.1.5 结构变化时间序列的单位根检验3.2 时间序列的协整检验与误差修正模型3.2.1 长期均衡关系与协整3.2.2 协整的E-G检验3.2.3 协整的JJ检验3.2.4 关于均衡与协整关系的讨论\*3.2.5 结构变化时间序列的协整检验3.2.6 误差修正模型.....第4章 微观计量经济学模型第5章 面板数据计量经济学模型第6章 非参数计量经济学模型第7章 空间计量经济学模型参考文献

<<高级应用计量经济学>>

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>