第一图书网, tushu007.com

<<高级计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<高级计量经济学>>

13位ISBN编号：9787309044430

10位ISBN编号：7309044436

出版时间：2005-5

出版时间：复旦大学出版社

作者：谢识予

页数：304

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

<<高级计量经济学>>

内容概要

《高级计量经济学》是为经济和管理类专业硕士、博士生编写的计量经济学教材。
全书共分为四篇，第一篇绪论的两章分别介绍计量经济学的范畴、方法、历史，和随机变量、统计推断及随机过程的准备知识；第二篇经典回归分析分三章介绍线性回归分析、非线性回归分析和联立方程组模型；第三篇是时间序列数据计量经济分析专题，介绍时间序列计量经济分析的一般原理、分布滞后模型、自回归移动平均模型、向量自回归和自回归条件异方差模型等；第四篇介绍面板数据、离散选择和非参数模型等，还有特殊数据、变量和估计方法的计量经济专题。
为了让读者对计量经济学有较好的总体把握，和能更加有效地应用计量经济分析方法，本教材特别重视对计量经济学范畴、结构、方法论，以及各种计量经济模型内在联系和区别的分析。
为了方便读者阅读和提高读者的阅读效率，本教材尽量控制运用数学工具的难度和范围，尽可能用通俗易懂的方法进行表述。

作者简介

谢识予，男，1962年生。
现为复旦大学世界经济系教授、数量经济学专业博士生导师，全国经济对策论研究会（中国数量经济学会经济对策论分会）副理事长，中国数量经济学会高校委员会委员，复旦大学经济学博士。
主要教学和研究领域包括博弈论、计量经济学、经济增长理论和经济数学方法等。
近年来发表论文数十篇，出版专著和教材多部。
获得全国普通高等学校优秀教材奖、上海市优秀教学成果奖、上海市哲学社会科学优秀成果奖等多项教学科研奖励。

<<高级计量经济学>>

书籍目录

第一篇 绪 论第一章 计量经济学的范畴、方法和发展第一节 计量经济学的范畴和方法第二节 计量经济学的历史和发展简评第二章 随机变量、统计推断和随机过程第一节 随机变量和概率分布第二节 参数估计和假设检验第三节 随机过程及其平稳性本篇思考练习题第二篇 经典回归分析第三章 线性回归分析第一节 线性回归模型及其假设第二节 参数估计第三节 线性回归拟合度评价、统计推断和预测第四节 线性回归问题诊断和处理第四章 非线性回归分析第一节 非线性回归模型第二节 非线性回归参数估计第三节 非线性回归评价和假设检验第四节 非线性回归预测第五章 联立方程组模型第一节 联立方程组模型及其假设第二节 联立方程组模型的识别性第三节 联立方程组模型的参数估计本篇思考练习题第三篇 时间序列计量经济学第六章 时间序列、动态计量和非平稳性第一节 时间序列分析方法第二节 自回归分布滞后模型第三节 平稳性和非平稳时间序列分析第七章 自回归移动平均模型分析第一节 自回归移动平均模型第二节 自回归移动平均模型的识别第三节 自回归移动平均模型的估计第四节 ARMA模型检验和预测第八章 向量自回归和自回归条件异方差模型第一节 向量自回归模型第二节 自回归条件异方差模型本篇思考练习题第四篇 面板数据、特殊变量和非参数模型第九章 面板数据模型第一节 面板数据模型基础第二节 固定效应模型第三节 随机效应模型第四节 变系数模型第五节 动态模型第十章 特殊因变量模型第一节 离散因变量模型基础第二节 二元选择模型第三节 二元选择模型参数估计第四节 二元选择模型设定检验第五节 双变量与多变量Probit模型第六节 多重选择模型第七节 截断回归模型第八节 审查回归模型第九节 持续数据模型第十一章 非参数模型第一节 非参数模型与非参数估计基本方法第二节 概率密度的核估计第三节 非参数回归模型第四节 半参数模型本篇思考练习题附录一 矩阵代数相关知识附录二 统计表主要参考文献

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