

<<非参数计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<非参数计量经济学>>

13位ISBN编号：9787310019069

10位ISBN编号：7310019067

出版时间：2003-7

出版时间：南开大学

作者：叶阿忠

页数：385

字数：364000

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>

<<非参数计量经济学>>

内容概要

本书全面系统地介绍了近30年来非参数计量经济学的主要研究成果，尤其是非参数回归模型、半参数回归模型和非参数联立方程模型的主要研究成果。

介绍了非参数回归模型的核估计、局部线性估计、近邻估计、正交序列估计、多项式样条估计和惩罚最小二乘估计，非参数计量经济联立方程模型的局部线性工具变量估计、局部线性两阶段最小二乘估计和局部线性广义矩估计，还有半参数线性回归模型、半参数非线性回归模型和半参数二元离散选择模型等半参数回归模型的估计。

本书不仅介绍各种模型的各种估计方法，更重要的是，对每种估计方法都有具体的例子，并给出模型估计计算的途径——或是通过软件S—PLus2000实现，或是给出Matlab计算程序，或是给出Gauss计算程序。

本书可作为经济管理类各专业本科生、硕士生和博士生高级计量经济学的教材，也可供广大数量经济管理领域科研人员、教师和学生阅读。

<<非参数计量经济学>>

书籍目录

序序前言第1章 导论 1.1 线性和非线性回归模型的回顾. 1.1.1 线性回归模型的回顾 1.1.2 非线性回归模型的回顾 1.2 非参数回归模型 1.3 非参数计量经济学的内容体系和本书的主要贡献第2章 密度函数的非参数估计 2.1 参数密度函数的估计 2.2 一元密度函数的核估计 2.2.1 独立样本情形 2.2.2 相关样本情形 2.3 多元密度函数的核估计第3章 一元非参数计量经济模型 3.1 非参数回归模型的概念 3.2 一元非参数回归模型的核估计 3.2.1 Nadaraya-Watson估计 3.2.2 窗宽的选择 3.2.3 核函数的选择 3.2.4 核估计的性质 3.2.5 一元非参数回归模型的变窗宽核估计 3.2.6 核估计的例子 3.3 一元非参数回归模型的局部线性估计 3.3.1 不变窗宽局部线性估计 3.3.2 不变窗宽局部线性估计的性质 3.3.3 变窗宽局部线性估计 3.3.4 变窗宽局部线性估计的性质 3.3.5 非参数回归模型的稳健估计LOWESS 3.3.6 局部线性估计的例子 3.4 K-近邻估计 3.4.1 K-近邻均匀权估计 3.4.2 K-近邻核权估计 3.4.3 近邻估计的例子 3.5 正交序列估计 3.5.1 正交序列估计 3.5.2 Legendre多项式正交基和正交序列估计例子 3.5.3 Fourier基和正交序列估计例子 3.6 多项式样条估计 3.6.1 多项式样条估计 3.6.2 多项式样条估计的例子 3.7 惩罚最小二乘法 3.7.1 惩罚最小二乘法 3.7.2 惩罚最小二乘估计法的例子第4章 多元非参数回归模型 4.1 多元非参数回归模型的核估计 4.1.1 不变窗宽核估计 4.1.2 变窗宽核估计 4.2 多元非参数回归模型的局部线性估计 4.2.1 不变窗宽局部线性估计 4.2.2 变窗宽局部线性估计 4.3 多元非参数回归模型的近邻估计 4.4 多元非参数回归模型的正交序列估计.....第5章 半参数回归模型第6章 非参数联立方程模型参考文献附录1 数据集附录2 S-PLUS2000使用指南附录3 MATLAB使用指南附录4 GAUSS使用指南附录5 MATUAB和GAUSS程序精选

<<非参数计量经济学>>

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>