

<<高级经济计量学>>

图书基本信息

书名：<<高级经济计量学>>

13位ISBN编号：9787500468479

10位ISBN编号：7500468474

出版时间：2008-5

出版时间：中国社会科学出版社

作者：李雪松

页数：253

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>

<<高级经济计量学>>

内容概要

本书是在中国社会科学院研究生院硕士及博士研究生《高级经济计量学》课程讲义的基础上编辑而成的，较为系统地介绍了高级经济计量学的知识体系及相关最新进展。

全书共分为十二章，其中第一章至第五章为高级经济计量学的核心方法，内容包括最大似然估计、广义矩方法、半参数方法、贝叶斯分析以及分位数回归；第六章至第九章为时间序列分析，内容包括ARMA过程与ARCH模型、协整与误差修正模型、向量自回归以及状态空间模型；第十章及第十一章为微观经济计量学，包括离散选择模型、托比特模型以及微观面板数据分析，第十二章为非平稳的宏观面板数据分析。

本书思路清晰，层次分明，在理论方法的叙述及公式推导方面力求深入浅出、通俗易懂。

本书可作为经济类及管理类硕士研究生及博士研究生的教材，也可作为社会各届人士查阅或使用有关模型方法的参考书。

<<高级经济计量学>>

作者简介

李雪松，经济学博士，中国社会科学院数量经济与技术经济研究所研究员，中国社会科学院研究生院教授，中国数量经济学会学术委员。

目前的主要研究领域为：经济模型理论及应用；中国宏观经济跟踪分析与预测。

1998-2000年，三度在荷兰中央计划局（CPB）从事中国经济可计算一

<<高级经济计量学>>

书籍目录

前言第一章 最大似然估计与假设检验 第一节 最大似然估计与条件最大似然估计 一 最大似然估计 二 条件最大似然估计 第二节 最大似然估计量的性质及准最大似然估计 一 最大似然估计量的性质 二 最大似然估计及其性质案例 三 最大似然估计量方差的估计 四 准最大似然估计 第三节 三种常用的假设检验 一 似然比检验 二 沃尔德检验 三 拉格朗日乘数检验(得分检验) 四 三种检验方法的比较 第四节 案例分析 一 最大似然估计及参数约束检验案例 二 参数约束检验实证分析案例 第五节 数值最大化方法 一 格子搜索法 二 最陡爬坡法 三 牛顿—拉夫森方法 思考题第二章 广义矩方法 第一节 经典矩方法 一 基本概念 二 经典矩方法 三 经典矩估计量渐近协方差的计算 第二节 广义矩方法及其性质 一 广义矩方法 二 一般广义矩估计量的性质 第三节 最优权矩阵与最优GMM 一 最优权矩阵的选择 二 最优GMM估计示例 三 最优GMM估计量数值算法的步骤 第四节 过度识别约束检验 一 线性回归模型的GMM估计 二 过度识别约束检验(Hansen检验或者J检验) 思考题第三章 非参数与半参数方法 第一节 非参数密度估计 一 局部直方图法 二 罗森布拉特—帕森核估计方法 三 k近邻估计方法 四 可变窗宽核估计方法 第二节 密度函数核估计量的性质及其最优窗宽的选择 一 密度函数核估计量的性质 二 密度函数核估计过程中窗宽的选择与嵌入估计 三 多元密度函数的核估计 第三节 非参数回归模型 一 纳达那亚—沃森核回归方法 二 核回归中窗宽的选择及其交叉核实估计 三 多元非参数模型的核回归估计 四 非参数模型的局部线性回归估计 五 非参数模型的k近邻估计 第四节 半参数线性回归模型第四章 贝叶斯分析与MCMC算法第五章 分位数回归与自助法第六章 ARMA过程与ARCH模型第七章 协整与误差修正模型第八章 向量自回归第九章 状态空间模型与卡尔曼滤波第十章 离散选择模型与托比特模型第十一章 面板数据分析第十二章 非平稳面板数据分析主要参考书目

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>