

图书基本信息

书名：<<面板数据模型及其在经济分析中的应用>>

13位ISBN编号：9787505875159

10位ISBN编号：7505875159

出版时间：2008-9

出版时间：经济科学出版社

作者：王志刚

页数：204

字数：280000

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>

内容概要

本书分别就面板数据的静态模型，动态模型、单位根和协整分析，受限因变量、变系数模型和随机前沿模型等六大领域进行了全面探讨，侧重介绍静态模型、动态模型、单位根和协整分析。

与同类作品比较，本书有三个突出特点：第一，经典例子多。

结合最新的国际期刊论文——新政治经济学代表人物阿塞莫格鲁教授2003年的经典之作《财富的逆转》，卢卡斯的理性预期模型，经典的跨国经济增长收敛性检验等，通过提炼经典论文的要点，帮助读者更加深入地思考和熟练地掌握各种面板数据分析方法。

第二，实用性强。

结合国外比较流行的计量软件Stata进行深入浅出的实战演练，并帮助经济研究人员用较短的时间、全面系统地掌握面板数据模型。

第三，覆盖面广。

它涉及面板数据模型的众多领域。

作者简介

王志刚，1976年生，2005年毕业于北京大学光华管理学院应用经济系国民经济专业，获经济学博士学位，现就职于财政部财政科学研究所。

先后在《管理世界》、《中国社会科学》、《财政研究》、《税务研究》等国家级核心期刊发表论文多篇；2006-2007年，先后担任《中

书籍目录

第1章 引言 第1节 面板数据发展历程 一、面板数据分类 二、面板模型的优势和不足 第2节 面板数据在社会科学中的应用 第2章 静态面板模型 第1节 遗漏变量问题 一、遗漏变量 二、个体效应模型 第2节 随机和固定效应模型 一、基本概念 二、等相关模型 三、固定效应还是随机效应模型 四、严格外生假定 第3节 各类面板估计量 一、混合回归估计量 二、组间估计量 三、组内估计量或固定效应估计量 四、一次差分估计量 五、随机效应估计量——可行广义最小二乘法 六、双因子效应模型 第4节 面板模型的稳健标准差 一、面板稳健标准差 二、面板自助标准差 第5节 各类检验 一、混合回归模型对随机效应模型 二、混合回归模型对固定效应模型 三、随机效应对固定效应：豪斯曼检验 四、各种自相关检验 五、群组间的异方差 第6节 非平衡面板数据 第7节 预测 第8节 统计量的特征比较 第9节 软件命令和应用实例 一、面板模型的软件命令 二、应用实例 第3章 动态面板数据模型 第1节 工具变量法和广义矩估计 一、工具变量法 二、二步法工具变量回归 三、广义矩估计 四、各种检验 第2节 工具变量的选取 一、同期外生假定 二、弱外生假定 三、强外生假定 四、过多的工具变量 五、相关的软件命令 六、应用实例 第3节 严格外生性条件的违反和初始条件 一、基本假定 二、最简单的动态模型 三、各种检验 第4节 动态面板模型的带虚拟变量固定效应估计 一、动态模型 二、软件命令 第5节 面板模型工具变量法和广义矩估计 一、基本模型 二、一阶差分估计 三、广义矩估计 四、各种检验 第6节 动态面板数据的蒙特卡罗分析 一、模型设定 二、软件命令 第7节 极大似然估计 第8节 进一步讨论 第9节 二次差分估计量 一、一次差分 二、二次差分 第10节 应用实例 一、生产函数估计 二、增长的收敛性验证 三、就业方程估计 四、卢卡斯理性预期模型的广义矩估计 第11节 软件命令操作 一、差分方程估计的软件命令 二、系统广义矩估计 三、各种命令对比分析 第4章 面板数据的单根检验和协整分析 第1节 面板数据单位根检验方法 一、数据生成过程 二、莱文-林检验 三、伊姆-皮萨然-申检验 四、哈德里检验 第2节 面板协整检验 一、考检验 二、基于残差的拉格朗日乘数检验 三、佩德罗尼检验 四、似然比检验 第3节 面板的误差修正模型 一、误差修正检验 二、面板检验统计量 三、误差修正检验统计量的渐近分布 四、存在截面相关时的检验统计量 第4节 应用实例 一、面板单位根检验 二、面板协整检验和误差修正模型 第5节 软件命令 第5章 面板受限因变量模型 第1节 二元选择模型 第2节 静态面板离散选择模型 一、二元选择模型 二、固定效应的逻辑模型 三、随机效应的概率单位模型 四、面板随机效应托比模型 第3节 动态面板离散选择模型 第4节 选择性样本和面板数据磨损问题 一、选择性样本 二、赫克曼二步估计的概率单位模型 三、样本选择和面板模型 第5节 应用实例 第6章 变系数模型 第1节 介绍 第2节 随横截面个体而变化的系数 一、固定系数模型 二、随机系数模型 第3节 系数随着时间和横截面单位同时发生变化 一、固定系数模型 二、随机系数模型 第4节 软件命令和应用实例 一、命令介绍 二、投资需求函数 第7章 随机前沿估计 第1节 随机前沿生产函数 一、随机前沿生产函数和技术效率 二、复合残差项的分布 第2节 异方差情形下的效率估计 一、随机扰动项具有异方差 二、无效率项具有异方差 三、随机扰动项和无效率项都具有异方差 第3节 面板数据的随机前沿生产函数 一、基本模型 二、随时间变化的技术无效率项 三、进一步讨论 四、非单调生产效率模型 第4节 软件命令和应用实例 一、命令介绍 二、中国生产效率估计(1978-2003年) 第8章 Stata软件基本操作 第1节 Stata简介和网上资源 一、软件简介 二、网络资源 三、使用界面 第2节 软件的基本操作 一、数据管理 二、命令的格式与基本命令 第3节 基本的回归分析 一、回归命令 二、预测的语法格式 三、回归诊断 四、应用实例 第4节 简单的编程附录 Stata10.0所有手册和命令一览参考文献英文—中文人名索引后记

章节摘录

第1章 引言 第1节 面板数据发展历程 微观计量经济学是计量经济学发展最快的领域之一，它涵盖的内容包括离散选择模型、面板数据模型、社会试验方法、计数数据（Count Data）模型、久期（Duration）模型、分层（Stratified）与聚类（Clustered）样本模型、托比（Tobit）模型、样本选择（Sample Selection）模型等，其中面板数据模型的应用范围相当广泛，涵盖了诸多计量模型，这也是我们本书讨论的核心内容，下面我们来简单回顾其发展历程。

1986年，萧政（Hsiao Cheng）出版了第一本《面板数据分析》，同时期有29项研究涉及这一个关键词：“面板数据（Panel Data）或纵列数据（Longitudinal Data）”。

根据社会科学文献索引指数（SSCI），截至2003年，有580篇研究，到2004年达到了687篇。

自从贝尔斯特拉（Balestra）和纳洛夫（Nerlove）于1966年发表了一篇研讨会议论文以来，对面板数据这一新的计量分析工具的应用取得了快速的发展。

国际上已经成立了专门研究Panel Data的协会，每两年举办一次全球学术交流大会，与会者都是从事Panel Data的经济学家、计量经济学家、统计学家和社会学家，大会强调除了在计量经济学领域外，要扩展其应用领域，以发现新的分析方法和研究领域，特别强调在社会学、经济学包括金融学，以及医学中的应用。

2007年7月在中国厦门大学举办了第14届国际面板数据大会，大会的主题发言代表了当前面板数据研究所取得的令人振奋的最新进展，再次表明了这一分析工具的重要地位和国际影响力，也必将对中国面板数据模型的应用起到积极的推动作用。

编辑推荐

《面板数据模型及其在经济分析中的应用》共分8个章节，分别就面板数据的静态模型，动态模型、单位根和协整分析，受限因变量、变系数模型和随机前沿模型等六大领域进行了全面探讨，侧重介绍静态模型、动态模型、单位根和协整分析。

该书可供各大专院校作为教材使用，也可供从事相关工作的人员作为参考用书使用。

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>