

<<现代计量经济学（下册）>>

图书基本信息

书名：<<现代计量经济学（下册）>>

13位ISBN编号：9787111266242

10位ISBN编号：7111266242

出版时间：2009-3

出版时间：机械工业出版社

作者：迈克尔 P.莫瑞

页数：338

译者：费剑平

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>

<<现代计量经济学（下册）>>

内容概要

本书系统介绍了计量经济学理论及其在经济实践中的应用。不仅注重计量经济学理论和方法的经典文献，还注重计量经济学的理论和方法在其他经济学应用研究中所取得的重要成果，包括一些有意思的案例。

在讲解计量经济学理论和方法的过程中，试图用语言文字把道理讲得透彻，而不是依靠数学推导。本书是下册内容，构成了计量经济学第二学期课程的基础。

这本优秀的计量经济学入门教材得到国内外著名计量经济学教授的推崇。全书不但系统、透彻地介绍了计量经济学理论及其在经济实践中的应用，还特别引入了活泼的教学方法、完美的习题和一些非常有趣的案例，无论是从学生还是教师的角度来看，都具有非常强的可读性，尤其是在进入计量经济理论和方法的介绍之前，作者试图引导学生自己设计估计量的讲授方法，非常自然、生动，如同亲临其课堂。

本书上册非常适合经济类、管理类本科生使用，下册适合作为经济学、金融学和统计学专业硕士研究生和博士研究生使用。

· 所有章节中的数学公式明显比同类教材要少，强调语言解释，而不是以数学推导介绍计量经济学的含义。

· 用蒙特卡罗模拟的方法向读者介绍，怎样理解回归以及统计量的无偏性和有效性等统计特性，使读者很容易理解。

· 使用实际经济数据，使读者置身于实际经济环境中，让读者切实体会如何运用计量经济学知识分析、处理经济问题，使其有一种身临其境之感。

· 把计量经济学重要研究成果用“计量经济经典”专栏展示出来，对学生有启发意义。

· 本书案例所用的全部数据都用EViews、Stata、Excel和文本文件（ASCII文件）四种格式给出，有利于读者按照书中案例模仿练习，加深对计量知识的理解。

<<现代计量经济学(下册)>>

书籍目录

第12章 估计量的大样本性质一致性和渐近有效性 12.1 大样本或渐近的视角 12.2 渐近无偏性、一致性和概率极限 12.3 B 和 B_1 的一致性 计量经济经典12-1 边际消费倾向 12.4 将固定的 X 换成随机的 x 蒙特卡罗实验12.1 渐近有效性的序幕 12.5 渐近有效性和渐近分布 计量经济经典12-2 音乐制作 小结 讨论 习题第13章 工具变量估计 计量经济经典13-1 心脏病发作与心脏病治疗 13.1 再论弗里德曼和消费函数 13.2 工具变量估计 13.3 出现同期相关的原因 13.4 一个应用：工资方程与工具变量估计 13.5 工具变量与两阶段最小二乘法 计量经济经典13-2 公共住房 项目对孩子不好吗 13.6 检验 $E(Xe_1)$ 是否等于0 小结 讨论 习题 参考文献 附录13A 测量误差偏误的大小 附录13B 估计变量与两阶段最小二乘估计量的矩阵表述第14章 联立方程组 14.1 联立方程中的内生变量和外生变量 14.2 1普通最小二乘法的联立偏误 14.3 识别问题 14.4 一个应用：富尔顿鱼市 14.5 间接最小二乘法、过度识别和识别不足 14.6 工具变量与联立偏误计量经济经典14-1 西瓜的供给与需求 14.7 最优的工具变量与两阶段最小二乘法 14.8 识别的阶条件和秩条件 14.9 一个应用：富尔顿鱼市上的两阶段最小二乘估计 计量经济经典14-2 监禁与犯罪 小结 讨论 习题 参考文献 第15章 随机实验与自然实验第16章 面板数据分析第17章 预测第18章 随机趋势变量第19章 Probit模型与Logit模型 统计学附录 概率论与统计学概要术语表

<<现代计量经济学（下册）>>

章节摘录

第12章 估计量的大样本性质：一致性和渐近有效性 只要将数学定律用于现实，它们就是不确定的。

而只要它们是确定的，那它们就无法用于现实。

——爱因斯坦 一个星期六的夜晚，一名醉汉在路灯下用双手和双膝

着地缓慢地爬行着。

一名警察碰巧经过。

“你在干什么？”

”警察盘问道。

“我在找我的车钥匙。

”醉汉含糊不清地回答道。

“哦，你把它掉在这里了，是吗？”

”警察问道。

“不是的，我把它扔在那里了，”醉汉一边指向一个黑暗的小巷一边回答道，“但这里的光线好一些。

”醉汉的办法向我们警示了计量经济建模中的一个风险。

简化假定和在分析上对方便的让步可能会破坏经验研究的基础，让你从一开始就注定失败。

不过，巧妙选择的简化假定和分析便利性对于促进我们的理解有重要帮助。

无偏性和一致性是在直觉上有吸引力的估计量选择准则，但在以后章节将遇到的数据生成过程中，寻找无偏估计量通常都倍受打击。

要么寻找一个无偏估计量在数学上超出了我们的能力，要么我们不具备无偏估计量所需要的信息。

为了克服这些困难，计量经济学家在新的领域寻找最佳估计量。

他们设计无偏性和有效性的便于分析的替代选择，作为选择估计量的准则。

在这些新的分析中，计量经济学家研究估计量随着样本容量无限增大时的表现。

.....

<<现代计量经济学（下册）>>

媒体关注与评论

我相信本书将是颇受中国读者青味的教材。

受过本书的系统训练，在做实证研究时，足以为应用者提供坚实的理论基础和得当的分析方法。

——林少宫 这是一本非常有价值的好书。

能同时具备上述特点的计量经济学著作是不多见的，特别是蒙特卡罗模拟的介绍方式也启发了我，以后何不用这种方式向学生介绍回归统计量的各种性质？ ——张晓峒

<<现代计量经济学（下册）>>

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>