

<<高级计量经济学（下册）>>

图书基本信息

书名：<<高级计量经济学（下册）>>

13位ISBN编号：9787301187739

10位ISBN编号：7301187734

出版时间：2011-5

出版时间：北京大学出版社

作者：金赛男,靳云汇

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（下册）>>

### 内容概要

《高级计量经济学(下册)》详细介绍了计量经济学的理论与方法,包括广义矩估计,非线性回归模型,回归方程组,联立方程组,面板数据模型,离散因变量模型,截取、断尾与样本选择模型,含滞后变量的回归模型,时间序列模型,以及非参数估计等内容。

《高级计量经济学(下册)》不仅介绍了建模的技术和方法,而且阐述了模型的理论背景。在介绍经典模型、传统的估计和检验方法的同时,《高级计量经济学(下册)》也介绍了相关领域一些现代的重要成果。

为便于读者学习和理解,《高级计量经济学(下册)》在相关章节中给出了范例,并结合例题介绍了相应的计量软件。

《高级计量经济学(下册)》适合作为高等院校经济学、管理学相关专业的研究生教材,也适合从事定量研究的相关学者参考。

《高级计量经济学(下册)》配有教学课件,如有需要,请填写书后的“教师反馈及课件申请表”索取。

<<高级计量经济学（下册）>>

作者简介

靳云汇，1939年生，1962年毕业于北京大学数学力学系计算数学专业(六年制)。1960-1978年在北京大学数学力学系任教，1979年至今在北京大学经济系、经济学院、光华管理学院任讲师、副教授、教授、博士生导师，主要从事计量经济学的教学与研究。

..

## &lt;&lt;高级计量经济学(下册)&gt;&gt;

## 书籍目录

## 第十五章 广义矩估计(gmm)

§ 1 矩估计

§ 2 广义矩估计

§ 3 线性回归模型中的gmm估计量

§ 4 一个实证研究的例子

## 第十六章 非线性回归模型

§ 1 非线性回归模型设定

§ 2 非线性回归模型估计

§ 3 假设检验

§ 4 设定检验

## 第十七章 回归方程组

§ 1 引言

§ 2 sur模型的ols估计

§ 3 sur模型的gls估计

§ 4 一些讨论

§ 5 奇异协方差矩阵

§ 6 极大似然估计

§ 7 示例八

## 第十八章 联立方程组

§ 1 联立方程组简介

§ 2 联立方程组的识别

§ 3 联立方程组的估计

§ 4 循环系统(recursive system)

§ 5 检验

§ 6 示例

## 第十九章 面板数据模型

§ 1 面板数据模型简介

§ 2 静态面板数据模型

§ 3 动态面板数据模型

§ 4 示例

## 第二十章 离散因变量模型

## 第二十一章 截取、断尾与样本选择模型

## 第二十二章 含滞后变量的回归模型

## 第二十三章 平稳时间序列

## 第二十四章 单位根和协整

## 第二十五章 非参数估计

参考文献

建模练习题

中英文术语对照表

章节摘录

版权页：插图：最早认识到总体矩可以作为估计的基础的是Karl Pearson，他在19世纪90年代后期发表的文章中提出了矩估计（Method Of Moments，MM）的思想。

现在看来，作为寻找点估计的最古老方法，MM法具有两个基本特征。

首先，它是基于经验分布的估计方法，在大样本的情况下经验分布能近似总体的真实分布，因此MM法需要通过渐近理论来证明自身的合理性；其次，它不需要假定任何分布，也不利用总体分布中除了总体矩之外的任何信息，正是在这种意义下，MM法也被有些人看成是一种非参数（nonparametric）方法。

在已经知道总体分布的情况下，MM法可能不再是最佳的选择，它得出的估计量还可以得到进一步的改进，然而MM法的使用非常简单。

MLE法的另一个弊端是，对于复杂模型而言，极大似然估计的计算量将会非常巨大，在一些实际应用中可能写不出似然函数的解析式，这将使极大似然估计陷入困境。

相反，GMM理论提供一种计算相对便捷的推断模型，且并不需要设定似然函数。

<<高级计量经济学（下册）>>

编辑推荐

<<高级计量经济学（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>