

<<微观计量经济学要义>>

图书基本信息

书名：<<微观计量经济学要义>>

13位ISBN编号：9787560929460

10位ISBN编号：756092946X

出版时间：2003-6

出版时间：华中科技大学出版社

作者：林少宫 编

页数：196

字数：248000

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>

## <<微观计量经济学要义>>

### 内容概要

微观计量经济学是计量经济学前沿发展的重要部分。

2000年诺贝尔经济学奖授予了在微观计量经济学方面做出卓越贡献的J. Heckman和D. McFadden教授，这充分显示了微观计量经济学的重大价值。

为了及时学习、普及并应用学科前沿知识，华中科技大学经济学院于2002年举办了“微观计量经济学高级研讨班”，邀请McFadden教授前来领衔主讲，同时组织在该院任职或兼职的教授做配套讲课，以补充微观计量经济学的一些基本概念和应用。

本书即是根据研讨班的讲课内容和资料整理而成的。

微观计量经济学无论从问题、数据要求或估计方法上看都有别于宏观计量经济学。

后者基本上可概括为时间序列计量学，而前者不宜简称为横截面数据计量学。

微观计量经济学最凸显的问题是所谓经济选择或定性因变量问题。

人们先选择他们的分工或专业，然后才决定干多少。

这要求研究者考虑新的模式、设计新的数据和使用新的方法。

本书中，McFadden教授演讲特别提出了实验设计方法，为林少宫教授讨论了微观计量经济学中的实验设计；在McFadden教授的研究中他都要强调要分析因果关系，相应地，唐齐鸣教授在讲解综列数据方法时就着重讲解固定效应法在因果分析中的作用；艾春荣、宋敏研究了颇具有计量特色的“最佳商品期货对冲比的半参数估计”等等。

计量经济学的最新发展重在应用，特别是用于政策（事件）的评价。

微观计量经济学的应用价值、前途宽广，未可限量。

有志于应用者——不仅在经济领域，而且在社会、政治、心理、管理等领域——将会发现本书是一本开卷有益、拓展视野的新计量经济学读物。

<<微观计量经济学要义>>

作者简介

林少宫，广东省信宜市人，1944年毕业于国立中央大学（南京大学前身），1952年获美国伊利诺斯大学经济学博士学位，其学位论文随即被《美国经济评论》分类为统计学与计量经济学。回国前曾任美国俄亥俄州地顿（Dayton）大学统计学和经济学讲师。1955年到华中工学院（华中科技大

## &lt;&lt;微观计量经济学要义&gt;&gt;

## 书籍目录

- 代序 微观计量经济学的发展和展望 1 引言 2 线性模型 3 非线性模型 4 广义矩方法 5 模型检验 6 非参数和半参数模型 7 展望线性模型 多元线性回归系数的“其余情况不变”释义 1 引言 2 多元回归的OLS估计与解释 3 受控变量过少的严重性 4 “代理”与“工具” 5 讨论 5.1 边际效应 5.2 受控变量越多越保险吗 5.3 t值小而R2值大的估计方程没有用吗？ 5.4 只关注某些 j或它们的某种组合 6 因果效应与综列数据 7 结束语 综列数据回归 1 引言 2 长期序列 3 短期序列 3.1 固定效应 3.2 随机效应 3.3 随机效应与固定效应 跨时横截面的混合、综列数据方法及其应用 1 引言 2 跨时独立横截面的混合 3 利用混合横截面做政策分析 4 综列数据分析中的固定效应模型 4.1 两期综列数据分析 4.2 用两期综列数据做政策分析 4.3 多于两期的综列数据分析中的固定效应模型 5 综列数据分析中的随机效应模型 正交实验设计在微观计量经济学中的应用——政策（或事件）评价法 1 回归设计与分析 2 正交设计与分析 3 正交设计的价值非线性模型 离散选择模型 1 引言 2 二分选择模型的估计 3 有序选择模型 4 多分选择模型 限值因变量模型及其应用 1 引言 2 线性概率模型 2.1 线性概率模型的定义 2.2 线性概率模型的估计问题 2.3 线性概率模型的应用 3 对数单位模型 3.1 对数单位模型的定义 3.2 对数单位模型的估计 3.3 对数单位模型的应用 4 概率单位模型 4.1 概率单位模型的定义 4.2 概率单位模型的估计 4.3 概率单位模型的应用 5 托比模型 5.1 托比模型的定义及其估计 5.2 对托比模型估计值的解释 5.3 托比模型的应用 5.4 托比模型的设定问题 6 泊松回归模型 6.1 泊松回归模型的定义及其估计 6.2 对泊松回归模型的解释 6.3 泊松回归模型的应用 7 截取和断尾回归模型 7.1 截取回归模型 7.2 断尾回归模型 微观计量经济学中的非线性模型 1 引言 2 托比模型 3 选择模型 4 开关模型 5 离散回归模型 5.1 二分离散变量模型 5.2 多分有序选择模型 5.3 多分无序选择模型 6 广义矩法 6.1 GMM的思想 6.2 GMM的特征方法论与专题研究 统计大样本理论杂谈 1 大样本 2 大样本概念及问题演变简史 3 大样本的研究问题与方法 3.1 问题 3.2 方法 4 研究者的必备条件 健康、财富与智慧 1 引言 1.1 议题 1.2 研究对象 2 综列数据中的关联性与因果性 2.1 因果性检验 2.2 某些具体的模型 2.3 测量问题 3 AHEAD综列数据 3.1 样本特征 3.2 统计描述 3.3 构造变量 3.4 财富的度量 3.5 死亡与观测的财富变化 4 SES与当时健康状态 4.1 关联模型 4.2 相对风险 5 突发（偶发）病和对AHEAD综列数据中因果关系进行检验 5.1 突发病模型 5.2 因果关系检验 6 检验从健康状况到资产积累的非因果关系 6.1 突发病模型 6.2 因果关系检验 6.3 模拟实验 怎样量化环境损坏或改善的经济价值 1 引言 1.1 机制失灵 1.2 信息失效 2 环境评估的主要问题 2.1 评价实验的基本知识 2.2 实验设计中的争议 3 评估环境损坏或改善的三种方法 3.1 按质论价法 3.2 旅途成本法 3.3 TCM在抽样方面的争议 3.4 直接的偏好诱出法 4 支付意愿 微观计量经济学中的实验设计法 1 引言 2 回归分析中的控制对象及控制方法 3 不可观测变量的控制 4 对数据的要求与数据的利用 5 随机化的普遍应用性 6 重复与误差 7 实验经济学微观金融计量方法及其应用研究 金融计量中的事件研究经验谈 1 事件研究的基本步骤 2 测度正常表现的模型 2.1 常均值收益模型 2.2 市场模型 2.3 经济模型 3 测度和分析非正常收益 3.1 市场模型的估计 3.2 非正常收益的统计特性 3.3 非正常收益的加总 金融市场信息的有效性与价格的可预测性 1 市场信息有效性与随机漫游假设的关系 2 随机漫游假设 2.1 鞅模型 2.2 随机漫游1：独立同分布增量 2.3 随机漫游2：独立增量 2.4 随机漫游3：无关增量 3 随机漫游假设的检验 3.1 检验随机漫游1：独立同分布增量 3.2 检验随机漫游2：独立增量 3.3 检验随机漫游3：无关增量 商品期货最佳对冲比率的半参数估计 1 引言 2 在玉米、棉花和大豆市

<<微观计量经济学要义>>

场上的应用      2.1 数据      2.2 应用参数对冲模型时的对冲效果      2.3 应用半参数模型  
时的对冲表现      2.4 应用参数和半参数模型时的样本外对冲效果      3 结论      4 附录附录  
流行计量经济学软件      1 EViews 4.0      2 GAUSS 3.6      3 LIMDEP 7.0      4 OX 2.2      5  
RATS 5.0      6 SAS 8.1      7 STATA 7.0      8 TSP 4.5

<<微观计量经济学要义>>

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>