

<<计量经济理论和方法>>

图书基本信息

书名：<<计量经济理论和方法>>

13位ISBN编号：9787810984546

10位ISBN编号：7810984543

出版时间：2006-4

出版时间：上海财经大学出版社

作者：（美）戴维森/（美）麦金农才/沈根祥

页数：686

译者：沈根祥

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>

<<计量经济理论和方法>>

内容概要

本书是一本在北美和欧洲不同层次的计量经济学教学中采用的优秀教材，除了其内容的详细程度和自封性表明是一本教材外，其涉及问题的难度及深度，更像是一本专著。

本书使具有一般数学基础的读者从更深层次上学习计量经济学的现代内容成为可能。

本书的起点低，除了在第一章对基本的概率论和数理统计知识进行介绍之外，对书中用到的一些常用的数学方法也进行了不厌其烦的介绍，如函数的泰勒级数展开、矩阵、逆矩阵的定义和性质等等。

当然这些介绍以够用为限，往往在用到的时候给出。

与同类教材相比，本书对有关内容的处理更加详细，对于常用的一些方法给出了有关的理论推导。

例如White检验方法、单位根检验和协整理论等。

本书常常通过简单的例子阐释复杂的理论。

作者凭借对计量经济学精深的理解和多年教学的经验，恰如其分地给出很多经典例子，使读者对一些抽象定理和理论的理解豁然开朗。

例如在讲解两种不同类型的极大似然估计量时，通过大家熟知的均匀分布把两种估计量的区别以及在不同场合的用途讲解得很清楚。

书中大量的图形和几何解释也有助于初学者对理论的理解和把握。

本书使有一定计量经济学基础的读者能够在较短时间内处于计量经济研究的前沿。

本书内容新颖，很多方法都是第一次在此类教科书中出现。

例如模拟矩方法（SMM）、间接推断方法（Indirect inference method）、OPG回归、双倍长度人工回归等。

书中参考文献引用以近年发表的论文居多，最新的文献引用截至2004年。

与现有的同类著作相比，本书在很多地方有其鲜明的特点，其中包括：（1）用一章的篇幅（第二章）介绍线性回归的几何理论，以投影为工具，使得古典线性回归模型有关理论的处理非常简洁和直观。

FWL定理的使用，使许多问题的处理大为简化，而且更容易看出这些方法的实质。

例如对季节调整的处理、虚拟变量作用的解释以及异常观测对回归结果的影响能力的分析等等。

（2）自助法的应用。

现代计量经济学以大样本理论为基础，而现实中样本的缺少往往使大样本理论有关结论的有效性大为降低。

自助法的应用能够大大改善大样本结论的有限样本性质。

同时，自助法的应用也很容易实现。

自助法的应用贯穿本书始终，成为区别于同类教材的一个显著特点。

（3）人工回归的采用。

同FWL定理一样，人工回归的巧妙采用，使很多复杂问题的处理大为简化，尤以牛顿—高斯回归最为典型。

（4）置信区间的处理不同于传统方法。

第5章中置信区间和置信区域的求法，采用假设检验反推的方法给出，理解起来也许有些别扭。

采用从假设检验反推置信区间的目的，是为了在置信区间中采用自助法。

考虑到这一点，就不难理解为什么作者采用这种处理方法。

本书练习中用到的数据可以从作者指定的网页上免费下载，为读者进行有关实际问题模拟提供了宝贵资源。

在本书的翻译中，常用并熟知的数学家，尤其是作为某些重要定理和理论名称的数学家名字按固定译法译出，如牛顿，高斯，毕达哥拉斯等，其余的作者名字在译文中则保留西文。

对术语的翻译参考了科学出版社1982年版的《英汉数学词汇》和清华大学出版社2005版的《英汉数学词汇》。

对于容易引起歧义的术语翻译，给出译者注释。

<<计量经济理论和方法>>

作者简介

R.戴维林是麦吉尔大学 (McGill University)加拿大计量经济研究会主席。
他在马赛的GREQAM (法国马赛的一个研究实验室) 讲授课程, 并曾在加拿大皇后大学 (Queen's University)从教多年。
他在爱丁堡大学获得物理学博士学位, 在英属哥伦比亚大学 (University of Columbia)获得经

<<计量经济理论和方法>>

书籍目录

译者的话 中文版序 前言 数据、习题解答和更正

1 回归模型 1.1 引言 1.2 分布、密度、矩 1.3 回归模型设定 1.4 矩阵代数 1.5 矩估计方法 1.6 关于练习 1.7 练习2 线性回归的几何学 2.1 引言 2.2 向量空间几何学 2.3 OLS估计的几何学 2.4 Frisch-Waugh-Lovell定理 2.5 FWL定理的应用 2.6 观测影响的杠杆作用 2.7 结语 2.8 练习3 最小二乘的统计性质 3.1 引言 3.2 参数的OLS估计量是无偏的吗 3.3 参数的OLS估计量是一致的吗 3.4 OLS参数估计的协方差矩阵 3.5 OLS估计量的有效性 3.6 残差和误差 3.7 线性回归模型的错误设定 3.8 拟合优度的度量 3.9 结语 3.10 练习4 线性回归模型的假设检验 4.1 引言 4.2 基本思想 4.3 几种常见分布 4.4 古典正态线性模型的精确检验 4.5 线性回归模型的大样本检验 4.6 模拟基础上的检验 4.7 假设检验的势 4.8 结语 4.9 练习5 置信区间 5.1 引言 5.2 精确置信区间和渐近置信区间 5.3 自助置信区间 5.4 置信区域 5.5 异方差一致的协方差矩阵估计 5.6 德耳塔方法 5.7 结语 5.8 练习6 非线性回归 6.1 引言7 广义最小二乘及相关主题 8 工具变量估计 9 广义矩方法 10 极大似然方法 11 离散因变量和受限因变量 12 多变量模型 13 平稳时间序列数据方法 14 单位根和协整 15 计量经济模型定检验 参考文献 术语对照表

<<计量经济理论和方法>>

编辑推荐

本书是一本在北美和欧洲不同层次的计量经济学教学中采用的优秀教材，除了其内容的详细程度和自封性表明是一本教材外，其涉及问题的难度及深度，更像是一本专著。

<<计量经济理论和方法>>

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>