

《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

出版社：北京大学出版社

作者：金赛男,靳云汇

页数：527

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.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

金赛男：1999-2004求学于于鲁大学经济系，师从世界级经济计量大师Peter C . B . Phillips和Donald Andrews，2004年获经济学博士学位，同年回国。从2004年8月开始在北京大学光华管理学院商务统计与经济计量系任教，主要研究领域为计量经济学理论和计量经济学应用，已在International Economic Review，Journal of Econometrics国际一流学术刊物上发表论文数篇。

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。

书籍目录

第十五章 广义矩估计 (GMM) /1 § 1 矩估计/3 § 2 广义矩估计/6 § 3 线性回归模型中的GMM估计量/19 § 4 一个实证研究的例子/30第十六章 非线性回归模型/36 § 1 非线性回归模型设定/37 § 2 非线性回归模型估计/43 § 3 假设检验/69 § 4 设定检验/71第十七章 回归方程组/75 § 1 引言/76 § 2 SUR模型的OLS估计/77 § 3 SUR模型的GLS估计/80 § 4 一些讨论/90 § 5 奇异协方差矩阵/93 § 6 极大似然估计/97 § 7 示例八03第十八章 联立方程组/108 § 1 联立方程组简介/109 § 2 联立方程组的识别/120 § 3 联立方程组的估计/125 § 4 循环系统 (Recursive System) /140 § 5 检验/142 § 6 示例/145第十九章 面板数据模型/47 § 1 面板数据模型简介/148 § 2 静态面板数据模型/152 § 3 动态面板数据模型/186 § 4 示例/196第二十章 离散因变量模型/198 § 1 二元因变量模型/199 § 2 多元选择模型/211 § 3 有序因变量模型/226第二十一章 截取、断尾与样本选择模型/228 § 1 截取、断尾与样本选择/229 § 2 截取回归模型/235 § 3 样本选择和断尾回归模型/243第二十二章 含滞后变量的回归模型/256 § 1 引言/257 § 2 有限分布滞后模型/259 § 3 无限分布滞后模型/267 § 4 动态回归模型/280第二十三章 平稳时间序列/293 § 1 时间序列分析中的基本概念/294 § 2 自回归和移动平均过程/300 § 3 ARMA模型的预测/315 § 4 ARMA模型的估计/321 § 5 诊断检验和阶的确定/330 § 6 向量自回归/333 § 7 结构化向量自回归/345 § 8 例子：中国人口时间序列建模/351第二十四章 单位根和协整/354 § 1 非平稳过程简介/355 § 2 趋势平稳过程/359 § 3 单位根过程的渐近工具/362 § 4 单位根检验/369 § 5 协整分析介绍/389 § 6 无协整关系的原假设的检验/400 § 7 协整系统的全信息极大似然分析/410 § 8 例子：消费和收入协整吗？/417第二十五章 非参数估计/419 § 1 单变量密度估计/420 § 2 多元密度估计/434 § 3 关于密度的假设检验/440 § 4 局部常数核估计/448 § 5 局部线性/多项式核估计/458 § 6 泛函系数模型/466 § 7 非参数模型设定检验/471 § 8 技术性附录/476参考文献/479建模练习题/487中英文术语对照表/505

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。

精彩短评

- 1、不可多得的好教材~
- 2、计量经济学的必读
- 3、这本书真的很不错啊，值得一读
- 4、看了之后感觉写得挺好。
- 5、不知道怎么有下的，我就买了，看看再说
- 6、很专业，思路清晰，是计量经济学进阶的好书！推荐。
- 7、著者很用心，作品有档次当当网也还给力
- 8、光华的书，挺好的
- 9、靳老师的书，当然是好书
- 10、终于拿到下册了。虽然下册的写作者比上册多，系统性和一致性方面、各章节的衔接方面比上册略有降低外，但是仍然保持上册的质量和风格。国内最好的计量教材。不比任何一本国外教材逊色。这个浮躁的年代，如此之作，非常可贵。感谢靳云汇老师、感谢各位作者。下册还是有些错误，不过容易发现，作者会在修正的。卓越发货很快，印刷保障质量。我要作为教材用了。
- 11、靳老师的书，国内顶级高校的流行教材。人行研究生部和光华等都在用。只是上册相对比较简单，属中级内容。
- 12、靳老师是国内计量的元老，此书专业，深入，值得收藏。
- 13、好书一直期待着出版
- 14、光华管院的教材确实不错。我上册是07年买的。等了5年，终于买到了。
- 15、本书的下册更具前沿性，虽然由于作者不同，使得一致性与连贯性略有不足，但肯定值得收藏，好好学习。
- 16、送货较快，书也不错。
- 17、上册是几年前买的，下册现在终于出版了
- 18、有些看不懂，可以当资料留存。
- 19、第三天隔天就收到商品了，发货速度挺快。遗憾的是封面弄破了。书本身装订也有问题，裁剪都不整齐。感觉亚马逊配送服务近来的质量下降了，以前连包装的箱子都是完好无损，书也是一尘不染的。但是现在每次包装的箱子都留下了配送途中暴力对待的痕迹。书的质量是无可挑剔的。考虑到装订差，有破损，配送服务质量下降等因素，勉强给个三星吧。
- 20、冲着金赛男老师的名气买的
- 21、印刷纸张都不错，内容上看，是国内为数不多的适合自学的计量教材
- 22、这应该是目前国内高级计量写得最好的，不必老外写得差，内容处理上提供了多种思路。证明也给得到位，比较像格林的那本书，读Hayashi的时候结合着这本书在看，感觉受益匪浅。推荐！！
- 23、体系很清楚！
- 24、属于初中级范畴，比较容易掌握，需要循序渐进
- 25、比起上册增加了难度，但是很详细
- 26、For the test
- 27、写的还行，考相关院校必备教辅了
- 28、本书有点难，很好的高级教材
- 29、下册比较难，需要多花工夫去读
- 30、下册内容很丰富。但是每个老师写其中的几个章节，写出来的东西定位高低不一。相对老说，靳云汇老师写的比较简洁易懂，苏良军写得就看得云里雾里的了，对学生的能力要求太高，不适合非计量专业的硕士看。
- 31、高级计量一本不错的参考书
- 32、明显是拼出来的书，质量和第一本差远了，甚至有很多小错误，符号的不一致更是显而易见。书的可读性和可用性都很差。
- 33、马上看完了，风格不统一看起来好累，云里雾里
- 34、没有想象中实用，缺少例子
- 35、好书啊，有时间要看看

《高级计量经济学（下册）》

- 36、虽然有点老，但是不错
- 37、这本书太经典了！没有错误，作者都很认真，这在当今浮躁的中国学术界很中的尊敬！买了不后悔！！
- 38、书写的很好，到货也很快
- 39、没有细读，感觉有些难度，应该是数学基础好的看起来才不吃力。像我这种文科学生看起来有些费劲。
- 40、计量内容知识点清晰，讲解比较清楚全面，需要多加学习，需要矩阵等相关知识。
- 41、买来做教学参考用的
- 42、准备买网上能找到的这方面的书，都还不错。
- 43、物流很快，但是物流的人态度差点

《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：www.tushu000.com