

《应用计量经济学》

图书基本信息

书名：《应用计量经济学》

13位ISBN编号：9787301266855

出版时间：2016-1-1

作者：迪米特里奥斯·阿斯特里奥, 史蒂芬·霍尔

页数：421

译者：陈诗一

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

《应用计量经济学》

内容概要

本书共21章，除导论外，分为六个部分--统计背景及基本数据处理、古典线性回归模型、背离古典线性回归模型假设、计量经济学专题、时间序列计量经济学、面板数据计量经济学，覆盖了从数据处理到面板数据等计量经济学的几乎所有重要主题。

《应用计量经济学》

作者简介

D.阿斯特里奥(D. Asteriou),Hellenic Open University大学经济学副教授，欧洲经济金融协会（EEFS）秘书长。S.霍尔(Hall)，英国Leicester University经济学教授。

书籍目录

第一部分统计背景和基础数据处理

第1章基本概念

引言

一个简单的例子

统计框架

抽样分布均值的性质

假设检验和中心极限定理

结论

第2章经济数据的结构和数据处理的基本方法

经济数据的结构

数据处理的基本方法

第二部分经典线性回归模型

第3章简单回归

回归入门：经典线性回归模型

普通最小二乘估计

经典线性回归模型的假定

OLS估计量的性质

整体拟合优度

假设检验和置信区间

如何用Microfit、EViews和Stata估计简单回归方程

回归结果的表示

应用

计算机实例：凯恩斯消费函数

问题与练习

第4章多元回归

引言

多元回归系数的推导

多元回归模型OLS估计量的性质

R²和调整R²

模型选择的一般准则

运用Microfit、EViews和Stata进行多元回归估计

假设检验

F形式的似然比检验

检验X的联合显著性

增加或删除解释变量

t检验（Wald检验的特殊情况）

LM检验

计算机实例：Wald、遗漏与冗余变量的检验

问题与练习

第三部分违背经典线性回归模型假定的情况

第5章多重共线性

引言

完全多重共线性

完全多重共线性的后果

不完全多重共线性

不完全多重共线性的后果

检测多重共线性

计算机实例

问题与练习

第6章异方差

引言：什么是异方差

异方差对OLS估计量的影响后果

检测异方差

对LM检验的批判

计算机实例：异方差检验

处理异方差

计算机实例：处理异方差

问题与练习

第7章自相关

引言：什么是自相关

什么导致了自相关

一阶和高阶自相关

OLS估计量自相关的后果

检测自相关

处理自相关

问题与练习

附录

第8章模型误设：错误的回归变量、测量误差以及错误的方程形式

引言

遗漏相关变量或包含无关变量

不同的函数形式

测量误差

错误设定的检验

实例：EViews中的Box—Cox转换

选择合适模型的方法

问题与练习

第四部分计量经济学的主题

第9章虚拟变量

引言：定性信息的本质

虚拟变量的应用

虚拟变量应用的计算机实例

虚拟变量应用的特殊情形

多类别虚拟变量的计算机实例

应用：新兴股票市场的一月效应

结构稳定性检验

问题

第10章动态计量经济模型

引言

分布滞后模型

自回归模型

练习

第11章联立方程模型

引言：基本定义

忽略联立性的后果

识别问题

联立方程模型的估计

实例：IS—LM模型

第12章受限因变量回归模型

引言

线性概率模型

线性概率模型的问题

logit模型

probit模型

Tobit模型

计算机实例：用EViews、Stata和Microfit运行probit模型和logit模型

第五部分时间序列计量经济学

第13章ARIMA模型及Box—Jenkins方法

引言：时间序列计量经济学

ARIMA模型

平稳性

自回归时间序列模型

移动平均模型

ARMA模型

单整过程与ARIMA模型

Box—Jenkins模型选择

实例：Box—Jenkins方法

问题与练习

第14章方差模型：ARCH—GARCH模型

引言

ARCH模型

GARCH模型

其他可选模型

ARCH / GARCH模型的实证举例

问题与练习

第15章向量自回归模型与因果检验

向量自回归模型

因果检验

计算机实例：金融发展与经济增长的因果关系

EViews、Stata和Microfit中的VAR模型估计和因果检验

第16章非平稳性与单位根检验

引言

单位根与伪回归

单位根检验

EViews、Microfit和Stata中的单位根检验

计算机实例：不同宏观经济变量的单位根检验

计算机实例：金融发展与经济增长的单位根检验

问题与练习

第17章协整与误差修正模型

引言：什么是协整

协整与误差修正机制（ECM）：一般方法

协整与误差修正机制：更数学的方法

协整检验

协整的计算机实例

问题与练习

第18章标准和协整情形下的模型识别

- 引言
- 标准情形下的模型识别
- 阶条件
- 秩条件
- 结论
- 第19章求解模型
- 引言
- 求解步骤
- 模型增加因子
- 模拟和脉冲响应
- 随机模型分析
- 在EViews中构建模型
- 结论
- 第六部分面板数据计量经济学
- 第20章传统面板数据模型
- 引言：面板数据的优势
- 线性面板数据模型
- 不同的估计方法
- 面板数据的计算机实例
- 把面板数据导入Stata
- 第21章动态异质性面板
- 引言
- 动态面板中的偏误
- 有偏性问题的解决（由面板的动态性导致）
- 异质性斜率参数的偏误
- 解决异质性偏误的方法：另一种估计方法
- 应用：经济增长和投资中的不确定效应
- 第22章非平稳面板
- 引言
- 面板单位根检验
- 面板协整检验
- 面板协整检验的计算机实例
- 第七部分计量软件的使用
- 第23章Microfit、EViews和Stata应用实例
- 关于Microfit
- 关于EViews
- 关于Stata
- Stata中的截面数据和时间序列数据
- 保存数据
- 附录统计表
- 参考文献

《应用计量经济学》

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