

《广义估计方程统计方法》

图书基本信息

书名：《广义估计方程统计方法》

13位ISBN编号：9787030386418

出版时间：2013-8-1

作者：周勇

页数：475

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

《广义估计方程统计方法》

内容概要

估计方程方法是统计推断中最为普通但也非常有用的统计推断方法之一,其思想和结果广泛应用于生存分析、生物统计,计量经济,及金融计量中.《广义估计方程统计方法》共分20章和两个附录,着重讨论参数模型、时间序列模型、非参数模型、半参数及变系数模型等模型中有关估计方程的统计推断方法,并讨论几种现代统计学中通常遇见的数据类型下估计方程方法.这是目前新的统计推断方法,主要包括最为常见的独立样本、非独立样本(时间序列样本)、纵向数据、缺失数据、缺失数据等下的估计方程方法.《广义估计方程统计方法》总结了一批应用估计方程方法进行统计推断的统计模型,同时也概括了可以应用一般估计方程方法处理的复杂数据.书中内容除了数理统计的常用统计推断方法外,也包括最新统计方法有关估计方程估计的研究成果.

《广义估计方程统计方法》

作者简介

周勇，男，国家杰出青年基金获得者，教育部长江学者，“新世纪百千万人才工程”国家人选，上海市科技领军人才后备队人选。1994年获中国科学院应用数学所理学博士学位，1996年北京大学概率统计系博士后，1997年香港大学社会学院统计与精算系博士后，香港理工大学商学院会计系研究员，美国北卡罗莱纳大学（UNC）生物统计系研究副教授。现任中国科学院数学与系统科学研究院研究员、（理学、管理科学与工程）博士生导师，上海财经大学统计与管理学院常务副院长，博士生导师；中国科技大学及云南大学兼职教授、博士生导师。

书籍目录

目录

《现代数学基础丛书》序

前言

第1章绪论

1.1 估计方程估计方法概述

1.2 统计模型与估计方程

1.3 带有辅助信息的估计方程估计

1.4 估计方程估计的渐近性质概述

1.5 广义估计方程估计相合性

第2章数据类型

2.1 简单数据

2.2 时间序列数据

2.3 删失数据

2.4 缺失数据

2.5 纵向数据（面板数据）

第3章准备知识

3.1 随机变量序列收敛性

3.2 大数律与中心极限定理

3.2.1 弱大数律和强大数律

3.2.2 重对数律

3.2.3 中心极限定理

3.2.4 估计的大样本性质

3.3 一致大数律及经验过程

3.4 一般极限定理

3.5 其他一些收敛定理

第4章Delta方法

4.1 Delta 方法的思想

4.2 向量估计函数Delta方法

4.3 相关研究及扩展

第5章矩估计与极大似然

5.1 矩估

5.2 极大似然估计

5.3 极大似然估计理论

5.4 信息阵及C—R不等式

5.5 有关极大似然估计的假设检验

5.6 删失数据下极大似然估计

5.7 截断数据极大似然

5.8 缺失数据极大似然估计

5.9 不可忽略缺失机制下的极大似然估计

5.10 条件似然估计

5.11 相关研究及扩展

.....

第6章极值目标函数估计

第7章经验似然及估计方程

第8章伪极大似然

第9章估计方程估计的渐近理论

第10章估计方程的一般思想

《广义估计方程统计方法》

- 第11章指数族及广义线性模型
- 第12章纵向数据估计方
- 第13章非参数估计方程
- 第14章非参和半参局部拟似然估计
- 第15章非参数时间序列估计方程方法
- 第16章删失数据下估计方程
- 第17章两样本估计方程
- 第18章光滑经验似然
- 第19章缺失数据估计方程
- 第20章缺失数据下分位数回归
- 附录A计数过程及其鞅理论
 - A.1 计数过程
 - A.2 鞅理论
 - A.3 风险率函数与生存分布
- 附录B非参数回归
 - B.1 非参数回归估计
 - B.2 局部线性估计
 - B.3 局部多项式回归
 - B.3.1 提出估计
 - B.3.2 局部多项式估计的偏差及方差
 - B.3.3 窗宽选择
 - B.3.4 核函数
 - B.3.5 补充
- 参考文献
- 索引
- 《现代数学基础丛书》已出版书目

《广义估计方程统计方法》

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:www.tushu000.com