

# 《计量经济学贝叶斯推断引论》

## 图书基本信息

书名：《计量经济学贝叶斯推断引论》

13位ISBN编号：9787810983846

10位ISBN编号：7810983849

出版时间：2005-7

出版社：上海财经大学出版社

作者：阿诺德·泽尔纳

页数：384

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](http://www.tushu000.com)

# 《计量经济学贝叶斯推断引论》

## 内容概要

本书是第一本系统地将贝叶斯推断应用于计量经济学领域以及用于建立模型、分析数据的经典著作。自1971年首次出版以来，该书不断重印，迄今仍在世界范围内具有持久的影响力。书中介绍计量经济学中贝叶斯推断和方法的内容，目前仍然适合用统计专业和计量经济学专业人士和学生。

本书内容全面、系统，由十二章和三个附录组成。第一章指明引导学生进入科学哲学和方法论一些基本主题的基础。第二章列出了在贝叶斯方法中用于推断的一些基本概念和运算，并进行了讨论。第三章至第九章专注于计量经济学研究中常会遇到的几个模型，并对它们作了贝叶斯分析，并做了许多贝叶斯的结论和抽样理论比较。第十章处理了假设检验问题和假设的比较。第十一章分析了几个与回归和其他过程相关的控制问题。在第十二章，作者陈述了一些结论性的看法。书中每章内容的最后都列出了一些相关的问题，以供读者学习完各章内容后加深了解和复习用。本书最后的三个附录对许多重要的一元分布和多元分布性质加以了介绍，并扼要地介绍了如何应用计算机程序进行一元和二元数值积分的方法。

本书表述流畅、层次清晰，用简明的方法和详细的数学推导阐述了计量经济学贝叶斯推断这个复杂的概念，是一本能够使统计学和计量经济学的专业人士，以及高年级本科生和研究生受益匪浅的优秀图书。

## 书籍目录

中文版序

序言

第一章 对经济推断的看法

1.1 科学的统一性

1.2 演绎推理

1.3 归纳推理

1.4 归谬推理

1.5 杰弗里斯对归纳推理理论的原则

1.6 这些规则的影响

问题

第二章 贝叶斯分析原理与应用

2.1 贝叶斯定理

2.2 贝叶斯定理与多组数据

2.3 先验概论密度函数

2.4 参数的边缘后验分布与条件后验分布

2.5 参数的点估计

2.6 参数的贝叶斯区域和区间

2.7 观测值的边缘分布

2.8 预测概率密度函数

2.9 点预测

2.10 预测区域和区间

2.11 贝叶斯后验分布密度的大样本性质

2.12 分析原理对帕累托分布的应用

2.13 分析原理对二项分布的应用

2.14 贝叶斯分析结论的报告

附录 "知道很少"先验分布的表示

问题

第三章 一元正态线性回归模型

3.1 简单的一元正态线性回归模型

3.1.1 模型及似然函数

3.1.2 具有分散先验分布参数的后验分布

3.1.3 在投资乘数分析中的应用

3.2 正态多元回归模型

3.2.1 模型及似函数

3.2.2 分散先验分布的参数下的后验分布

3.2.3 基于有信息先验分布的后验分布

3.2.4 预测密度

.....

第四章 回归分析中的特殊问题

第五章 变量中的误差

第六章 单个方程非线性模型的分析

第七章 时间序列模型：一些选用的例子

第八章 多元回归模型

第九章 联立方程经济模型

第十章 假设的比较和检验

第十一章 某些控制问题的分析

第十二章 结论

附录  
参考文献

# 《计量经济学贝叶斯推断引论》

## 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](http://www.tushu000.com)