

《高等计量经济学》

图书基本信息

书名：《高等计量经济学》

13位ISBN编号：9787040104462

10位ISBN编号：7040104466

出版时间：2002-10

出版社：高等教育出版社

作者：高炜宇

页数：239

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

《高等计量经济学》

内容概要

近十几年来，随着改革开放的深入计量经济学在中国有了长足的发展。一方面许多关于计量经济学理论和应用的论文和书籍不断地问世，另一方面计量经济学在宏观经济和区域经济的分析和预测中起着日益重要的作用。但是与西方发达国家相比，无论是计量经济学理论的研究，还是其应用的范围和水平上，我们都还有一定的差距。进一步推动计量经济学的教学、研究和应用，不仅对经济学的发展有益，也能促进宏微观层次上的经济决策和预测更加科学化，更有助于中国经济研究与国际的接轨。这说明计量经济学在中国有着非常广阔的理论和应用的发展前景。本书的写作就是希望在这方面做一点微薄的贡献。写一本介绍现代计量经济学当代发展成果的书是我的夙愿。因为国内近年来出版的计量经济学书籍主要侧重于计量经济学的基础理论，而比较少地涉及计量经济学当代的理论发展和应用。这本书试图从教学的角度在一定程度上填补这个空白。本书的内容和难度与西方国家研究生教育中一年级计量经济学课程的基本内容类似，也包括一些高年级的研究课程内容（例如非参数估计）。因此本书的目标读者是经济学专业的研究生和高年级的本科生，也包括一些有一定计量经济学基础的经济工作者。本书的内容基本涵盖了现代计量经济学的基本理论和模型。在本书的第二章中，我们对计量经济学的基础理论（主要包括线性回归模型、多元线性回归和联立方程模型）进行了简要的回顾。当然，对基础计量经济学有一定了解的读者可以跳过第二章直接进入后面的内容。

书籍目录

第一章 导论 第一节 计量经济学简介 第二节 计量经济学与经济学和经济活动的关系 第三节 计量经济学的分析对象 内容小结 参考文献第二章 基础计量经济学回顾 第一节 单方程线性回归 第二节 线性回归拟合度评价、统计推断和预测 第三节 单方程回归问题诊断和处理 第四节 联立方程组模型的识别和估计 第五节 单方程线性回归分析示例 内容小结 习题 参考文献第三章 非线性回归分析 第一节 非线性回归模型 第二节 非线性模型的参数估计 第三节 非线性回归评价和假设检验 第四节 非线性回归分析的预测 第五节 非线性回归参数估计示例 内容小结 习题 参考文献第四章 特殊应变量数据模型分析 第一节 特殊应变量数据模型概述 第二节 离散应变量模型 第三节 两元选择模型：Probit和Logit模型 第四节 离散应变量模型设定的检验 第五节 离散应变量模型应用举例 第六节 多元选择的离散应变量模型 第七节 审查回归模型：Tobit模型 第八节 特殊应变量数据模型的扩展 内容小结 习题 参考文献第五章 时间序列模型的分析 第一节 时间序列模型简介 第二节 平稳时间序列模型 第三节 非平稳时间序列模型 第四节 向量自回归模型 第五节 共积性时间序列模型 第六节 时间序列模型应用实例 第七节 时间序列模型扩展I：ARCH和GARCH模型 第八节 时间序列模型扩展II：状态空间模型与Kalman过滤器 内容小结 习题 参考文献第六章 面板数据模型的分析 第一节 面板数据模型简介 第二节 固定效应模型及其估计方法 第三节 随机效应模型及其估计方法 第四节 模型设定的检验 第五节 面板数据模型应用实例 第六节 面板数据模型扩展I：Hausman—Tabor模型 第七节 面板数据模型扩展II：变系数模型 第八节 面板数据模型扩展III：动态模型 内容小结 习题 参考文献第七章 非参数模型分析附录

《高等计量经济学》

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