

《计量经济学方法与应用》

图书基本信息

书名：《计量经济学方法与应用》

13位ISBN编号：9787300205844

出版时间：2015-3

作者：巴蒂·H·巴尔塔基

页数：411

译者：聂巧平,攸频,魏学辉

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.tushu111.com

《计量经济学方法与应用》

内容概要

《计量经济学方法与应用(第5版)》是一部阐述计量经济学基本方法和基本假定的教科书，其在证明各项定理的缜密的方法论与实证研究法中找到了一个很好的平衡点，内容主要包括时间序列分析、有界相关变量、面板数据分析、空间相关性分析和回归诊断等前沿课题，除此之外各章还有帮助理解书中所述内容的理论分析题。《计量经济学方法与应用(第5版)》涵盖了计量经济学的众多领域，通过运用真实数据让读者更好地理解 and 解释理论方法的实证结果。

书籍目录

第1章什么是计量经济学？

- 1.1引言
- 1.2简要历史
- 1.3计量经济学批判
- 1.4展望

注释

参考文献

第2章基本统计概念

- 2.1引言
- 2.2估计方法
- 2.3估计量的性质
- 2.4假设检验
- 2.5置信区间
- 2.6描述性统计量

注释

问题

参考文献

附录

第3章简单线性回归

- 3.1引言
- 3.2最小二乘估计和古典假设
- 3.3最小二乘法的统计特性
- 3.4的估计
- 3.5极大似然估计
- 3.6拟合优度的测量
- 3.7预测
- 3.8残差分析
- 3.9数值例子
- 3.10实证案例

问题

参考文献

附录

第4章多元回归分析

- 4.1引言
- 4.2最小二乘估计
- 4.3多元回归估计的残差解释
- 4.4回归方程的过度设定和设定不足
- 4.5和
- 4.6线性约束条件检验
- 4.7虚拟变量

注释

问题

参考文献

附录

第5章违背古典假设的模型

- 5.1引言
- 5.2零期望假设

5.3随机解释变量

5.4扰动的正态性

5.5异方差

5.6自相关

注释

问题

参考文献

第6章分布滞后和动态模型

6.1引言

6.2无限分布滞后

6.3带有序列相关的动态模型的估计与检验

6.4自回归分布滞后

注释

问题

参考文献

第7章一般线性模型：基础知识

7.1引言

7.2最小二乘估计

7.3分块回归和FrischWaughLovell定理

7.4极大似然估计

7.5预测

7.6置信区间和假设检验

7.7联合置信区间和假设检验

7.8受约束的极大似然估计和受约束的最小二乘

7.9似然比，Wald和拉格朗日乘子检验

注释

问题

参考文献

附录

参考文献

第8章回归模型的诊断与设定检验

8.1有影响的观测值

8.2递归残差

8.3模型的设定检验

8.4非线性最小二乘法和高斯—牛顿回归

8.5线性与对数—线性函数形式的检验

注释

问题

参考文献

第9章广义最小二乘法

9.1引言

9.2广义最小二乘

9.3 的特殊形式

9.4极大似然估计

9.5假设检验

9.6预测

9.7未知形式的

9.8W，LR，LM统计量的再讨论

9.9空间误差相关

注释

问题

参考文献

第10章似无关回归

10.1引言

10.2可行的GLS估计

10.3检验方差—协方差矩阵是否为对角阵

10.4不同观测值个数的似无关回归

10.5实证案例

问题

参考文献

第11章联立方程模型

11.1引言

11.2单方程估计：两阶段最小二乘

11.3系统估计：三阶段最小二乘

11.4过度识别约束的检验

11.5Hausman的设定检验

11.6实证案例

注释

问题

参考文献

附录：再议识别问题：识别的秩条件

第12章合并截面时间序列数据

12.1引言

12.2误差分量模型

12.3预测

12.4实证案例

12.5混合模型中的检验

12.6动态面板数据模型

12.7项目评价与差分差异估计量

问题

参考文献

第13章受限因变量

13.1引言

13.2线性概率模型

13.3函数形式：logit和probit

13.4分组数据

13.5个体数据：probit和logit

13.6二元响应模型回归

13.7预测的渐近方差和边际影响

13.8拟合优度的测量

13.9实证案例

13.10多元选择模型

13.11删失回归模型

13.12截尾回归模型

13.13样本选择

注释

问题

参考文献

附录

第14章时间序列分析

14.1引言

14.2平稳性

14.3BoxJenkins方法

14.4向量自回归

14.5单位根

14.6趋势平稳与差分平稳

14.7协整

14.8自回归条件异方差

注释

问题

参考文献

附录

图形索引

表格索引

术语表

《计量经济学方法与应用》

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.tushu111.com