

《非参数计量经济学》

图书基本信息

书名：《非参数计量经济学》

13位ISBN编号：9787301249675

出版时间：2015-3-1

作者：李奇,杰弗里·斯科特·拉辛

页数：565

译者：叶阿忠,吴相波

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

《非参数计量经济学》

内容概要

近年来，非参数和半参数计量方法日益引起学界的关注。李奇和杰弗里·斯科特·拉辛编著的这本《非参数计量经济学（理论与实践）》以一种直接、简便的形式，在汇集最新的计量理论与计量技术方面填补了空白。这一领域的大多著作均假定数据在本质上是严格连续的，而不是社会科学研究中常见的分类数据（名义数据及序数数据），因此，通常的非参数方法在处理离散变量时并不令人满意。《经济学前沿译丛·非参数计量经济学：理论与实践》针对应用计量经济学家和社会科学研究者的需求，在一个整合框架内强调了针对各种数据类型（如连续数据、名义数据和序数数据）的非参数技术，并在潜在无关变量存在的前提下讨论了非参数估计量的特性。

《经济学前沿译丛·非参数计量经济学：理论与实践》覆盖了非参数计量方法及其现实应用所需的全部内容。书中丰富的实证检验、数据和习题等内容使《经济学前沿译丛·非参数计量经济学：理论与实践》成为研究生学习非参数计量方法的理想教材，也成为相关研究人员必不可少的案头参考。

《非参数计量经济学》

作者简介

李奇，得克萨斯A&M大学经济学教授，休·罗伊·卡伦文学院讲席教授。

杰弗里·斯科特·拉辛（Jeffrey Scott Racine），麦克马斯特大学经济学教授，研究生项目统计学教授，威廉·麦克马斯特参议员计量经济学讲席教授。

叶阿忠，福州大学经济与管理学院教授，博士生导师，中国数量经济学会常务理事。主要讲授高级计量经济学和高级微观经济学等课程，主要从事计量经济理论及其应用和技术进步与经济增长等方面的研究。

吴相波，福州大学经济与管理学院讲师，主要研究方向是宏观经济学、计量经济学。主讲课程有高级宏观经济学、计量经济学、宏观经济分析与决策、经济预测与经济软件应用等。

书籍目录

第1部分 非参数核方法

第1章 密度估计

- 1.1 单变量密度估计
- 1.2 单变量窗宽选择：经验法则和插入法
- 1.3 单变量窗宽选择：交错鉴定法
- 1.4 单变量累积分布函数估计
- 1.5 单变量累积分布函数窗宽选择：交错鉴定法
- 1.6 多变量密度估计
- 1.7 多变量窗宽选择：经验法则和插入法
- 1.8 多变量窗宽选择：交错鉴定法
- 1.9 密度估计量的渐近正态性
- 1.10 一致收敛速度
- 1.11 高阶核函数
- 1.12 定理1.4的证明
- 1.13 应用
- 1.14 习题

第2章 回归

- 2.1 局部常数核估计
- 2.2 局部常数窗宽选择
- 2.3 一致收敛速度
- 2.4 局部线性核估计
- 2.5 局部多项式回归
- 2.6 应用
- 2.7 证明
- 2.8 习题

第3章 混合数据的频率估计

- 3.1 离散数据的概率函数估计
- 3.2 有离散回归元的回归
- 3.3 混合数据的估计：频率方法
- 3.4 关于频率方法一些要注意的说明
- 3.5 证明
- 3.6 习题

第4章 混合数据的核估计

- 4.1 离散数据联合分布的平滑估计
- 4.2 离散数据的平滑回归
- 4.3 有离散回归元的核回归：无关回归情形
- 4.4 混合数据的回归：相关回归元的情形
- 4.5 混合数据的回归：无关回归元的情形
- 4.6 应用
- 4.7 习题

第5章 条件密度估计

- 5.1 条件密度估计：相关变量的情形
- 5.2 条件密度窗宽选择

.....

第2部分 半参数方法

第3部分 一致模型的设定检验

第4部分 非参数近邻和序列方法

《非参数计量经济学》

第5部分 时间序列、联立方程和面板数据模型

附录A 背景统计概念

主题索引

译后记

《非参数计量经济学》

精彩短评

- 1、难，有问题，老师建议用英文版
- 2、难得一笔！确实是好书！
- 3、有些地方的公式是错的。。。
- 4、上课用的书

《非参数计量经济学》

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.tushu111.com