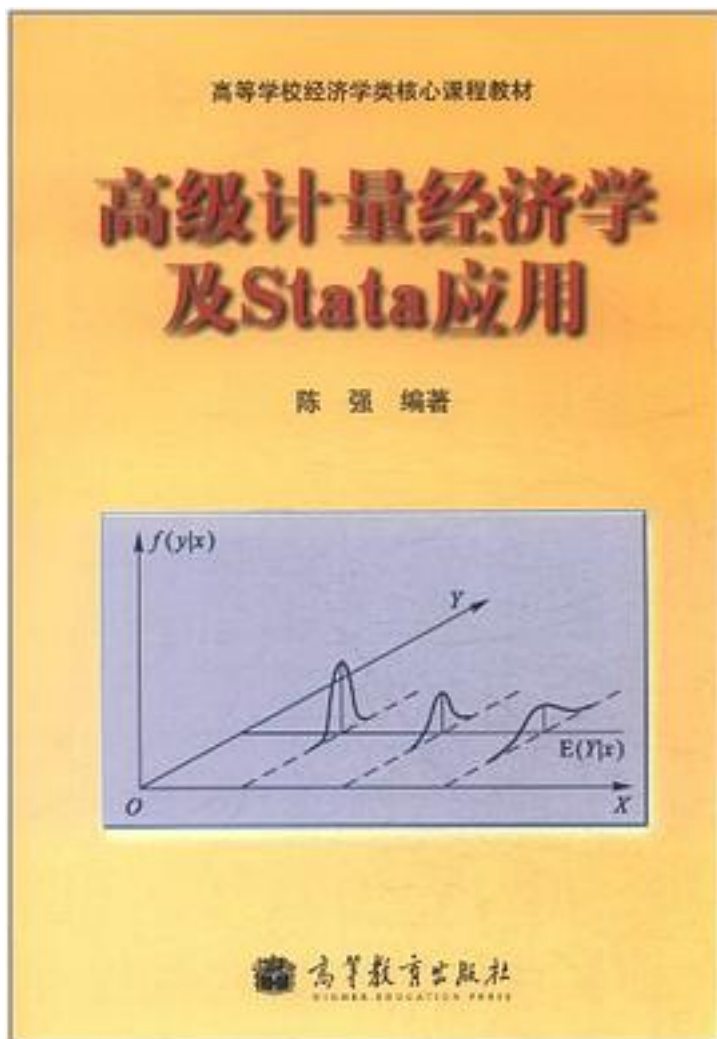


高级计量经济学及Stata应用



[高级计量经济学及Stata应用_下载链接1](#)

著者:陈强

出版者:高等教育出版社

出版时间:2014-4-1

装帧:平装

isbn:9787040329834

《经济学、管理学类研究生教学用书:高级计量经济学及Stata应用(第二版)》较多地借鉴了现代计量经济学的最新发展,内容全面,除了介绍传统的横截面数据外,对面板数据(含长面板、动态面板、非线性面板)、时间序列(含VAR、单位根、协整)、自然实验、重复截面数据、GMM、自助法、蒙特卡罗法、分位数回归、门限回归、非参数估计、处理效应、空间计量、久期分析、贝叶斯估计等均做了较深入的分析。此书力图以生动的语言、较多的插图与经济意义来直观地解释计量方法,而又不失数学的严谨性。同时,结合目前欧美最为流行的Stata计量软件,及时地介绍相应的Stata命令与实例,为读者提供“一站式”服务。此书适合普通高等学校经济学、管理学类或社科类硕士生、博士生与研究人员使用。为便于读者学习高级计量经济学,《经济学、管理学类研究生教学用书:高级计量经济学及Stata应用(第二版)》在内容安排上,假设读者已经学过微积分、线性代数与概率统计,但不要求学过本科阶段的计量经济学(学讨百好)。

作者介绍:

目录: 目录

第1章绪论

1.1什么是计量经济学

1.2经济数据的特点与类型

第2章概率统计回顾

2.1概率与条件概率

2.2分布与条件分布

2.3随机变量的数字特征

2.4迭代期望定律

2.5随机变量无关的三个层次概念

2.6常用连续型统计分布

2.7统计推断的思想

习题

附录

第3章小样本OLS

3.1古典线性回归模型的假定

3.2OLS的代数推导

3.3OLS的几何解释

3.4拟合优度

3.5OLS的小样本性质

3.6对单个系数的t检验

3.7对线性假设的F检验

3.8F统计量的似然比原理表达式

3.9分块回归与偏回归(选读)

3.10预测

习题

附录

第4章Stata简介

4.1为什么使用Stata

4.2Stata的窗口

4.3Stata操作实例

4.4Stata命令库的更新

4.5进一步学习Stata的资源

习题

第5章大样本OLS

5.1为何需要大样本理论

5.2随机收敛

5.3大数定律与中心极限定理

5.4统计量的大样本性质
5.5渐近分布的推导
5.6随机过程的性质
5.7大样本OLS的假定
5.8OLS的大样本性质
5.9线性假设的大样本检验
5.10大样本OLS的Stata命令及实例

习题

附录

第6章最大似然估计法

6.1最大似然估计法的定义
6.2线性回归模型的最大似然估计
6.3最大似然估计的数值解
6.4信息矩阵与无偏估计的最小
方差
6.5最大似然法的大样本性质
6.6最大似然估计量的渐近协方差矩阵
6.7三类渐近等价的统计检验
6.8准最大似然估计法
6.9对正态分布假设的检验
6.10最大似然估计法的Stata命令及实例

习题

附录

第7章异方差与GLS

7.1异方差的后果
7.2异方差的例子
7.3异方差的检验
7.4异方差的处理
7.5处理异方差的Stata命令及实例
7.6Stata命令的批处理

习题

附录

第8章自相关

8.1自相关的后果
8.2自相关的例子
8.3自相关的检验
8.4自相关的处理
8.5处理自相关的Stata命令及实例

习题

第9章模型设定与数据问题

9.1遗漏变量
9.2无关变量
9.3建模策略：“由小到大”还是“由大到小”
9.4解释变量个数的选择
9.5对函数形式的检验
9.6多重共线性
9.7极端数据
9.8虚拟变量
9.9经济结构变动的检验
9.10缺失数据与线性插值
9.11变量单位的选择

习题

附录

第10章工具变量，2SLS与GMM

- 10.1解释变量与扰动项相关的例子
- 10.2工具变量法作为一种矩估计
- 10.3二阶段最小二乘法
- 10.4有关工具变量的检验
- 10.5GMM的假定
- 10.6CMM的推导
- 10.7GMM的大样本性质
- 10.8如何获得工具变量
- 10.9MLE也是GMM
- 10.10工具变量法的Stata命令及实例

习题

附录

第11章二值选择模型

- 11.1离散被解释变量的例子
- 11.2二值选择模型
- 11.3二值选择模型的微观基础
- 11.4二值选择模型中的异方差问题
- 11.5稀有事件偏差（选读）
- 11.6含内生变量的Probit模型（选读）
- 11.7双变量Probit模型（选读）
- 11.8部分可观测的双变量Probit模型（选读）

习题

第12章多值选择模型

- 12.1多项Logit与多项Probit
- 12.2条件Logit模型
- 12.3混合Logit模型
- 12.4嵌套Logit

习题

第13章排序与计数模型

- 13.1排序模型
- 13.2泊松回归
- 13.3负二项回归
- 13.4零膨胀泊松回归与负二项回归
- 13.5计数模型的Stata实例

习题

第14章受限被解释变量

- 14.1断尾回归
- 14.2零断尾泊松回归与负二项回归
- 14.3随机前沿模型（选读）
- 14.4偶然断尾与样本选择
- 14.5归并回归
- 14.6归并数据的两部分模型
- 14.7含内生解释变量的Tobit模型（选读）

习题

附录

第15章短面板

- 15.1面板数据的特点
- 15.2面板数据的估计策略
- 15.3混合回归
- 15.4个体固定效应模型
- 15.5时间固定效应
- 15.6一阶差分法
- 15.7随机效应模型
- 15.8组间估计量

- 15.9拟合优度的度量
- 15.10非平衡面板
- 15.11究竟该用固定效应还是随机效应模型
- 15.12个体时间趋势
- 15.13短面板的Stata命令及实例
- 习题
- 第16章长面板与动态面板
- 16.1长面板的估计策略
- 16.2面板校正标准误
- 16.3仅解决组内自相关的FGLS
- 16.4全面FGLS
- 16.5组间异方差的检验
- 16.6组内自相关的检验
- 16.7组间同期相关的检验
- 16.8变系数模型
- 16.9面板工具变量法
- 16.10豪斯曼—泰勒估计量（选读）
- 16.11动态面板
- 16.12动态面板的Stata命令及实例
- 16.13偏差校正LSDV法
- 16.14重复截面数据与组群分析
- 习题
- 第17章非线性面板
- 17.1面板二值选择模型
- 17.2面板二值选择模型的随机效应估计
- 17.3面板二值选择模型的固定效应估计
- 17.4面板二值选择模型的Stata实例
- 17.5面板泊松回归
- 17.6面板负二项回归
- 17.7面板计数模型的Stata实例
- 17.8面板Tobit
- 17.9面板随机前沿模型
- 习题
- 第18章随机实验与自然实验
- 18.1实验数据
- 18.2理想的随机实验
- 18.3引入更多的解释变量
- 18.4随机实验执行过程中可能出现的问题
- 18.5自然实验
- 18.6双重差分法
- 18.7三重差分法
- 18.8观测数据的处理效应
- 习题
- 第19章蒙特卡罗法与自助法
- 19.1蒙特卡罗法的思想与用途
- 19.2蒙特卡罗法实例：模拟中心极限定理
- 19.3蒙特卡罗法实例：服从卡方分布的扰动项
- 19.4蒙特卡罗积分
- 19.5最大模拟似然法与模拟矩估计
- 19.6自助法的思想与用途
- 19.7自助法的分类
- 19.8使用自助法估计标准误
- 19.9使用自助法进行区间估计

19.10使用自助法进行假设检验
19.11自助法的一致性（选读）
19.12异方差情况下的自助法
19.13面板数据与时间序列的自助法
19.14自助法的Stata命令
19.15使用自助法进行稳健的豪斯曼检验

习题

附录

第20章平稳时间序列

20.1时间序列的数字特征
20.2自回归模型
20.3移动平均模型
20.4ARMA
20.5自回归分布滞后模型
20.6ARMA模型的Stata命令及实例
20.7误差修正模型
20.8MA (∞) 与滞后算子
20.9向量自回归过程
20.10VAR的脉冲响应函数
20.11预测误差的方差分解
20.12格兰杰因果检验
20.13面板格兰杰因果检验
20.14VAR的Stata命令及实例
20.15季节调整

习题

第21章单位根与协整

21.1非平稳序列
21.2ARMA的平稳性
21.3VAR的平稳性
21.4单位根所带来的问题
21.5单位根检验与平稳性检验
21.6单位根检验的Stata实例
21.7面板单位根检验
21.8协整的思想与初步检验
21.9Beveridge—Nelson分解公式
21.10协整的定义与最大似然估计
21.11协整分析的Stata实例

习题

附录

第22章自回归条件异方差模型

22.1条件异方差模型的例子
22.2ARCH模型的性质
22.3ARCH模型的MLE估计
22.4GARCH模型
22.5何时使用ARCH或GARCH模型
22.6ARCH与GARCH模型的扩展
22.7ARCH与GARCH的Stata命令及实例
22.8多维GARCH模型（选读）

习题

第23章似不相关回归

23.1单一方程估计与系统估计
23.2似不相关回归的假定
23.3SUR的FCLS估计
23.4SUR的假设检验

23.5似不相关回归的Stata命令及实例

23.6变系数面板数据的SUR估计

习题

附录

第24章联立方程模型

24.1联立方程模型的结构式与

简化式

24.2联立方程模型的识别

24.3单一方程估计法

24.4三阶段最小二乘法

24.5三阶段最小二乘法的Stata实例

24.6结构VAR

24.7SVAR的Stata实例

习题

第25章非线性回归与门限回归

25.1非线性最小二乘法

25.2非线性回归的Stata命令及

实例

25.3门限回归

25.4面板数据的门限回归

25.5门限回归的计算机操作

习题

第26章分位数回归

26.1为什么需要分位数回归

26.2总体分位数

26.3样本分位数

26.4分位数回归的估计方法

26.5分位数回归的Stata命令及实例

习题

第27章非参数与半参数估计

27.1为什么需要非参数与半参数估计

27.2对密度函数的非参数估计

27.3核密度估计的性质

27.4最优带宽

27.5多元密度函数的核估计

27.6非参数核回归

27.7多元核回归

27.8k近邻回归

27.9局部线性回归

27.10非参数估计的Stata命令及实例

27.11半参数估计

习题

附录

第28章处理效应

28.1处理效应与选择难题

28.2通过随机分组解决选择难题

28.3依可测变量选择

28.4匹配估计量的思想

28.5倾向得分匹配

28.6倾向得分匹配的Stata实例

28.7偏差校正匹配估计量

28.8双重差分倾向得分匹配

28.9断点回归的思想

28.10精确断点回归

28.11模糊断点回归
28.12断点回归的Stata实例
28.13处理效应模型
习题
第29章空间计量经济学
29.1地理学第一定律
29.2空间权重矩阵
29.3空间自相关
29.4空间自回归模型
29.5空间杜宾模型
29.6空间误差模型
29.7一般的空间计量模型
29.8含内生解释变量的SARAR模型
29.9空间面板模型
29.10空间计量方法的局限性
第30章久期分析
30.1久期数据的处理方法
30.2风险函数
30.3久期数据的归并问题
30.4描述性分析
30.5久期模型的最大似然估计
30.6比例风险模型
30.7加速失效时间模型
30.8Cox模型
30.9比例风险模型的设定检验
30.10分层Cox模型
30.11随时间而变的解释变量
30.12不可观测的异质性
30.13其他久期分析模型
30.14久期分析的Stata命令及实例
习题
第31章贝叶斯估计简介
31.1贝叶斯估计的思想
31.2贝叶斯定理
31.3贝叶斯估计的一个例子
31.4基于后验分布的统计推断
31.5先验分布的选择
31.6多元回归的贝叶斯分析
31.7马尔可夫链蒙特卡罗法
习题
第32章如何做规范的实证研究
32.1计量理论与现实数据
32.2实证研究的主要步骤
32.3实证论文的结构
32.4计量实践的十诫
32.5结束语
习题
附录：常用数据来源
参考书目
数学符号
英文缩写
• • • • • (收起)

标签

计量经济学

经济学

Stata

计量经济

STATA

统计

金融

经济

评论

陈强真男神

这本书简直是神书……例子很齐全，但是统计方面的知识最好事先有储备，不然读起来很累……

没人说数理部分吗，为自己的智商点蜡烛。不晓得这本教材好在哪里，可能唯一的优点就是比较全面并且结合了stata的例子吧。章节之间的逻辑关系还算清晰，可是章节内的小标题逻辑模糊、增加了理解难度，对一些理论的诠释上面也让人费解。和一般的教科书真没分别。

神书 等第三版

救命系列

写论文手头必备工具书

看了n遍才开窍

@Germán Rodríguez

哈哈哈哈哈 好 书

补记。仅参阅空间计量几章。

恩。

谢谢陈强老师写出此书！ 为学生指出明路

随手随时的工具书

算不上读完。#因为这是本脱离了现实的书

#基本上属于一本手把手教你用stata的一本教科书，为了做数据学了两章：Stata操作示例和短面板数据的处理。短面板处理一章举例是美国48个州基础数据与酒驾的关系，联合配套面板数据足够自学处理面板数据。祝我瓜毕业答辩成功。

比读研时教材简答，注重应用，挺适合复习

同学推荐的大神级教材，业界良心。实用工具书

神书

天下文章一大抄 连知识点顺序和插图都和某书一样

应用性强，通过比喻和案例深入浅出地讲解了各种模型。推导内容较少，如需更深入理解模型，需要自行寻找介绍推导的论文。

[高级计量经济学及Stata应用_下载链接1](#)

书评

这是一本将计量经济学和软件操作结合的教材，类似高铁梅的Eviews教材。虽然该书对计量方法的介绍比高铁梅的书好许多，但是最好还是别用来它学计量经济学，计量还是读伍德里奇和Hayashi（2000）吧。但它作为一个参考读物是可以的。该书最好的、最主要的用途还是学习stata软件操...

陈强老师这本书是非常好的一本讲计量经济学和stata的中文书籍，本书以实际操作为主，也有较为详尽的原理推导和解释基本上涉及了主要的计量经济学实证研究方法和一些前沿的研究方法。如果学经济学的本科生想快速上手写论文这本书不失为一本好书，书中有详尽的stata代码和回归结...

[高级计量经济学及Stata应用_下载链接1](#)