

# 高级计量经济学（下册）



[高级计量经济学（下册）\\_下载链接1](#)

著者:金赛男

出版者:北京大学出版社

出版时间:2011-5

装帧:平装

isbn:9787301187739

《高级计量经济学(下册)》详细介绍了计量经济学的理论与方法，包括广义矩估计，非线性回归模型，回归方程组，联立方程组，面板数据模型，离散因变量模型，截取、断

尾与样本选择模型，含滞后变量的回归模型，时间序列模型，以及非参数估计等内容。《高级计量经济学(下册)》不仅介绍了建模的技术和方法，而且阐述了模型的理论背景。在介绍经典模型、传统的估计和检验方法的同时，《高级计量经济学(下册)》也介绍了相关领域一些现代的重要成果。为便于读者学习和理解，《高级计量经济学(下册)》在相关章节中给出了范例，并结合例题介绍了相应的计量软件。

《高级计量经济学(下册)》适合作为高等院校经济学、管理学相关专业的研究生教材，也适合从事定量研究的相关学者参考。

《高级计量经济学(下册)》配有教学课件，如有需要，请填写书后的“教师反馈及课件申请表”索取。

## 作者介绍:

金赛男：1999-2004求学于于鲁大学经济系，师从世界级经济计量大师Peter C. B. Phillips和Donald Andrews，2004年获经济学博士学位，同年回国。从2004年8月开始在北京大学光华管理学院商务统计与经济计量系任教，主要研究领域为计量经济学理论和计量经济学应用，已在International Economic Review, Journal of Econometrics国际一流学术刊物上发表论文数篇。

靳云汇：1939年生，1962年毕业于北京大学数学力学系计算数学专业(六年制)。1960-1978年在北京大学数学力学系任教，1979年至今在北京大学经济系、经济学院、光华管理学院任讲师、副教授、教授、博士生导师，主要从事计量经济学的教学与研究。

目录: 第十五章 广义矩估计 (GMM) /1 § 1 矩估计/3 § 2 广义矩估计/6 § 3 线性回归模型中的GMM估计量/19 § 4 一个实证研究的例子/30第十六章 非线性回归模型/36 § 1 非线性回归模型设定/37 § 2 非线性回归模型估计/43 § 3 假设检验/69 § 4 设定检验/71第十七章 回归方程组/75 § 1 引言/76 § 2 SUR模型的OLS估计/77 § 3 SUR模型的GLS估计/80 § 4 一些讨论/90 § 5 奇异协方差矩阵/93 § 6 极大似然估计/97 § 7 示例八03第十八章 联立方程组/108 § 1 联立方程组简介/109 § 2 联立方程组的识别/120 § 3 联立方程组的估计/125 § 4 循环系统 (Recursive System) /140 § 5 检验/142 § 6 示例/145第十九章 面板数据模型/47 § 1 面板数据模型简介/148 § 2 静态面板数据模型/152 § 3 动态面板数据模型/186 § 4 示例/196第二十章 离散因变量模型/198 § 1 二元因变量模型/199 § 2 多元选择模型/211 § 3 有序因变量模型/226第二十一章 截取、断尾与样本选择 模型/228 § 1 截取、断尾与样本选择/229 § 2 截取回归模型/235 § 3 样本选择和断尾回归模型/243第二十二章 含滞后变量的回归模型/256 § 1 引言/257 § 2 有限分布滞后模型/259 § 3 无限分布滞后模型/267 § 4 动态回归模型/280第二十三章 平稳时间序列/293 § 1 时间序列分析中的基本概念/294 § 2 自回归和移动平均过程/300 § 3 ARMA模型的预测/315 § 4 ARMA模型的估计/321 § 5 诊断检验和阶的确定/330 § 6 向量自回归/333 § 7 结构化向量自回归/345 § 8 例子：中国人口时间序列建模/351第二十四章 单位根和协整/354 § 1 非平稳过程简介/355 § 2 趋势平稳过程/359 § 3 单位根过程的渐近工具/362 § 4 单位根检验/369 § 5 协整分析介绍/389 § 6 无协整关系的原假设的检验/400 § 7 协整系统的全信息极大似然分析/410 § 8 例子：消费和收入协整吗? /417第二十五章 非参数估计/419 § 1 单变量密度估计/420 § 2 多元密度估计/434 § 3 关于密度的假设检验/440 § 4 局部常数核估计/448 § 5 局部线性/多项式核估计/458 § 6 泛函系数模型/466 § 7 非参数模型设定检验/471 § 8 技术性附录/476参考文献/479建模练习题/487中英文术语对照表/505

• • • • • [\(收起\)](#)

## 标签

计量经济学

教材

Econometrics

经济

教科书

TBF

Economics

2014

## 评论

For the test

-----  
明显是拼出来的书，质量和第一本差远了，甚至有很多小错误，符号的不一致更是显而易见。书的可读性和可用性都很差。

-----  
马上看完了，风格不统一看起来好累，云里雾里

-----  
下册内容很丰富。但是每个老师写其中的几个章节，写出来的东西定位高低不一。相对老说，靳云汇老师写的比较简洁易懂，苏良军写得就看得云里雾里的了，对学生的能力要求太高，不适合非计量专业的硕士看。

-----  
[高级计量经济学（下册）\\_下载链接1](#)

书评

-----  
[高级计量经济学（下册）\\_下载链接1](#)