

《GMM估计矩条件的选取方法及其应用》

书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2016年05月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787514167115

内容简介

GMM估计作为计量经济学的基本估计方法，被广泛应用于经济与金融数据分析。尽管在相当一般的正则性条件下，GMM估计有着非常好的渐近性质，但是其有限样本表现却不尽人意。近年来，随着工具变量随样本容量变化的“许多工具变量”的应用，在提高IV计量的有效性的同时也出现了可能影响估计量有限样本表现的“弱工具变量”问题；对GMM估计方法的研究也逐渐转向“许多弱矩条件”的情形，并成为当前GMM估计研究的热点问题。《GMM估计矩条件的选取方法及其应用》在“许多矩条件”的框架下，研究了GMM估计矩条件的选取方法，用以改善GMM估计的有限样本表现。

作者简介

胡毅，男，中国科学院大学经济与管理学院讲师。2011年毕业于中山大学，获经济学博士学位。2012年至2014年在中国科学院数学与系统科学研究院从事管理科学与工程方向的博士后研究工作。主要研究方向为计量经济学模型及其在经济金融中的应用，迄今在Journal of Air Transport Management、Applied Economics Letters、Communications in Nonlinear Science and Numerical Simulations、《数量经济技术经济研究》、《统计研究》、《系统工程理论与实践》等国内外学术期刊发表论文42篇，其中，**或通讯作者30篇，SCI/SSCI收录18篇，国家自然科学基金委管理科学部A类期刊15篇，参与出版译著1部，曾获得中国数量经济学会优秀论文奖一等奖、中国管理科学学术年会优秀论文奖。主持国家自然科学基金及中国博士后科学基金各1项。兼任中国系统工程学会青年工作委员会委员、中国优选法统筹法与经济数学研究会青年工作委员会委员、中国运筹学会决策科学分会第四届理事会理事。

目录

第1章 绪论

- 1.1 研究意义
- 1.2 研究思路
- 1.3 研究方法
- 1.4 基本框架
- 1.5 研究创新

第2章 文献综述

2.1 引言

2.2 IV估计的相关理论综述

2.3 GMM估计的相关理论综述

2.4 高阶渐近展开理论综述

2.5 模型选取相关理论综述

2.6 本章小结

第3章 线性同质模型GMM估计矩条件的选取方法

3.1 引言

3.2 研究背景

3.3 模型设定与假设

3.4 选取准则的构建

3.5 蒙特卡罗模拟

3.6 本章小结

第4章 非线性异质模型GMM估计矩条件的选取方法

4.1 引言

4.2 研究背景

4.3 模型设定

4.4 GMM估计量的高阶MSE与近似MSE

4.5 矩条件选取准则的构建

4.6 模拟分析

4.7 本章小结

第5章 GMM估计矩条件选取方法的算法实现

5.1 引言

5.2 问题界定

5.3 算法设计

5.4 算法测试

5.5 本章小结

第6章 实证应用：我国居民教育收益率测算

6.1 引言

6.2 模型设定与数据描述

6.3 估计及结果解释

6.4 本章小结

第7章 结论

7.1 研究结论

7.2 进一步研究方向

参考文献

附录

第3章 附录

第4章 附录

后记

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)