

图书基本信息

书名：<<应用Bootstrap方法的空间相关性检验>>

13位ISBN编号：9787030316554

10位ISBN编号：703031655X

出版时间：2011-6

出版时间：科学出版社

作者：龙志和 等著

页数：132

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：<http://www.tushu007.com>

## 内容概要

本书将基础理论研究与实际应用工具相结合，应用一种非参数方法——Bootstrap方法解决空间经济计量分析中的空间相关性检验难题，本书首先基于线性回归模型的OLS估计残差，利用Bootstrap方法构建空间相关性检验统计量，通过数理推导和模拟实验证明Bootstrap方法用于空间相关性检验的有效性；其次，基于空间滞后模型的GMM或2SLS估计残差，提出空间相关性检验统计量（OLL-Moran）的渐近分布和精确分布；最后，基于空间滞后模型的2SI，S估计残差，利用Bootstrap方法构建空间相关性检验统计量，通过数理推导和模拟实验证明Bootstrap方法用于空间相关性检验的有效性，本书在Gauss软件中编写一系列Bootstrap方法和空间相关性检验程序，丰富了Gauss软件工具箱，本书可供高等院校和科研机构的研究人员，尤其是经济计量、空间经济计量和经济金融领域的研究者使用。

## 书籍目录

## 第1章 绪论

- 1.1 空间关系：空间相关性和空间异质性
- 1.2 空间经济计量模型
- 1.3 空间相关性检验方法
  - 1.3.1 Moran's I检验
  - 1.3.2 空间误差相关检验
  - 1.3.3 空间滞后相关检验
- 1.4 空间相关性检验方法的异同及面临的问题
- 1.5 本书结构

## 第2章 Bootstrap方法

- 2.1 Bootstrap, Jackknife和Monte Carlo方法的区别和联系
- 2.2 常见的Bootstrap方法
  - 2.2.1 残差Bootstrap方法
  - 2.2.2 参数Bootstrap方法
  - 2.2.3 Wild Bootstrap方法
  - 2.2.4 Pairs Bootstrap方法
  - 2.2.5 Block Bootstrap方法
- 2.3 传统经济计量领域Bootstrap方法有效性研究
  - 2.3.1 Bootstrap方法有效性数理推导的研究成果
  - 2.3.2 Bootstrap方法有效性模拟分析的研究成果
  - 2.3.3 Bootstrap方法有效性研究成果评价
- 2.4 本章小结

## 第3章 线性回归模型Bootstrap Moran检验有效性的数理证明

- 3.1 相关研究背景
- 3.2 模型假定
- 3.3 Bootstrap方法有效性推导
  - 3.3.1 Moran's I统计量分布函数的Edgeworth展开
  - 3.3.2 Moran's I统计量分布函数的渐近Edgeworth展开
  - 3.3.3 Bootstrap Moran检验的渐近改进
  - 3.3.4 Bootstrap Moran检验的有效性
- 3.4 本章小结

## 第4章 线性回归模型Bootstrap Moran检验有效性的模拟分析

- 4.1 线性回归模型Bootstrap Moran检验有效性研究思路
  - 4.1.1 线性回归模型Bootstrap Moran检验思路
  - 4.1.2 线性回归模型Bootstrap Moran检验的P值
  - 4.1.3 线性回归模型Bootstrap Moran检验的水平扭曲
  - 4.1.4 线性回归模型Bootstrap Moran检验的功效
- 4.2 Bootstrap Moran检验有效性的Monte Carlo实验设计
  - 4.2.1 Monte Carlo实验参数设定
  - 4.2.2 Monte Carlo实验步骤
  - 4.2.3 Monte Carlo实验方案
- 4.3 Bootstrap Moran检验有效性的Monte Carlo实验结果与分析
  - 4.3.1 正态误差情况下Bootstrap Moran检验的水平扭曲和功效
  - 4.3.2 异方差误差情况下Bootstrap Moran检验的水平扭曲和功效
  - 4.3.3 混合分布误差情况下Bootstrap Moran检验的水平扭曲和功效

<<应用Bootstrap方法的空间相 >

4.4 本章小结

第5章 空间滞后模型中Moran ' s I统计量的分布性质

5.1 空间滞后模型的估计

5.1.1 ML估计

5.1.2 2SLS估计

5.1.3 GMM估计

5.2 OLL-Moran检验的精确分布

5.3 OLL-Moran检验的渐近分布

5.3.1 数理证明

5.3.2 模拟分析

5.4 本章小结

第6章 空间滞后模型Bootstrap Moran检验有效性的数理证明

6.1 模型假定

6.2 Bootstrap Moran检验有效性推导

6.2.1 Moran ' s I统计量分布函数的Edgeworth展开与渐近Edgeworth展开

6.2.2 Bootstrap Moran检验的渐近改进与有效性

6.3 本章小结

第7章 空间滞后模型Bootstrap Moran检验有效性的模拟分析

7.1 空间滞后模型Bootstrap Moran检验思路

.....

第8章 空间经济计量模型检验有限样本性质研究总结

参考文献

附录

#### 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:<http://www.tushu007.com>