

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787030160652

10位ISBN编号：7030160657

出版时间：2005-9

出版时间：科学出版社

作者：张润清

页数：228

字数：298000

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>

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 前言

1998年7月，教育部高等学校经济学学科教学指导委员会指定将“计量经济学”列入经济类专业核心课程，标志着计量经济学已经成为我国高等院校经济学科、管理学科等专业中开设的最重要课程之一。

计量经济学方法正在逐步成为经济预测与决策、现代经济管理不可或缺的工具，如宏观计量经济学之父克莱茵教授所说：“在大多数大学和学院中，计量经济学的讲授已成为经济学课程中最具权威的一部分。”

编者自1992年起，一直从事本科生和研究生的计量经济学教学工作，对计量经济学有着深刻的理解。

本书的成稿凝结着编者多年的心血和汗水，是在编者的教学讲义基础上修改、完善而成的，其中许多章节的内容都有编者独到的见解。

鉴于我们教授的对象是普通高等院校经济管理类的学生，在行文过程中，吸收了许多理论与实践中的例子，力争将来源于实践的计量经济学理论和方法还原，用于指导具体经济问题。

本书还将计量经济学模型及其应用与现代计量经济学软件（EViews）进行了有机结合，试图让学生在没有任何教师指导的情况下也能顺利读懂本书，并很好地运用EViews软件解决所研究的实际问题。

希望通过本书的教学使学生了解计量经济学在经济学科体系中的地位和作用，了解计量经济学发展的历史、现状及发展趋势，掌握以最小二乘法为主线的计量经济学的基本理论与方法，有意识地锻炼他们发现问题、分析问题，用量化方法解决问题的能力，培养学生对经济学的敏锐洞察力和先进方法的应用能力，以达到提高学生专业素质的目的。

本书注重理论联系实际，将实例与EViews软件相结合来说明理论与方法，内容衔接紧密，图文并茂，章前有小结，章后有思考与练习题，文字通俗，繁简得当，是适用于普通高等院校经济、管理类专业的本科生教材，也可作为相关专业人员自学读物。

张润清、崔和瑞担任本书主编，并对全书进行修改、总纂和定稿，王俊芹、谭砚文和宗义湘担任副主编。

参加编写的人员有：马腾、王俊芹、石会娟、李小静、李晓红、刘晓东、刘彩云、张丽、张润清、宗义湘、徐铮、郝清民、崔和瑞、卢建昌、谢艳辉、谭砚文等。

## <<计量经济学>>

### 内容概要

全书共分十二章。

第一章介绍了计量经济学的基本问题；第二至四章系统地讲述了满足古典假定条件下线性回归模型参数估计的基本理论和方法；第五至九章系统地讲述违背古典回归假定的单方程计量经济模型；第十章讲述联立方程计量经济模型；第十一和十二章深入浅出地论述了计量经济学的应用。

本书注意理论与实际相结合，自始至终以研究现实经济问题为出发点来说是本书所讲述的理论与方法；结构安排清晰，内容衔接紧密，图文并茂，章前有主要的内容导引，章后有思考与练习题，为便于读者掌握书中理论及其应用。

本书所选案例均用EViews3.0软件进行分析，为读者学习计量经济学提供了方便。

本书可作为普通高等院校经济、管理类等专业本科生教材，也可作为相关专业人员的自学读物。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 计量经济学的基本问题 第一节 计量经济学概述 一、计量经济学的含义 二、计量经济学的学科地位 三、计量经济学的发展概况 第二节 计量经济学的研究对象与内容体系 一、计量经济学的研究对象 二、计量经济学的内容体系 三、计量经济学的分类 第三节 计量经济学的模型的建立 一、理论模型的设计 二、样本数据的收集 三、模型参数的估计 四、模型的检验 思考与练习题

第二章 一元线性回归模型 第一节 一元线性回归模型概述 一、相关与回归的基本概念 二、一元线性回归模型 第二节 一元线性回归模型参数估计 一、古典假定 二、四种重要的关系式 三、普通最小二乘法 四、估计量的统计学性质 五、估计量 $b_0$ 与 $b_1$ 的分布 六、随机项 $u$ 的方差 $\sigma^2$ 的估计量 第三节 显著性检验 一、拟合优度与相关系数检验 二、回归系数估计量的检验(t检验) 第四节 一元线性回归模型案例及预测 一、点预测 二、区间预测 三、一元线性回归模型实例分析 思考与练习题

第三章 多元线性回归模型 第一节 多元线性回归模型及假定 一、多元线性回归模型 二、多元线性回归模型的假定 第二节 多元线性回归模型的参数估计及统计性质 一、多元线性回归模型的参数估计 二、估计参数的统计性质 第三节 显著性检验 一、拟合优度检验 二、方程显著性检验 三、变量显著性检验 四、利用多元线性回归方程进行预测 五、多元线性回归分析实例 第四节 最大似然估计 一、似函数 二、极大似然估计法的基本思想 三、一元与多元线性回归模型的最大似然估计

第四章 线性模型的扩展 第一节 非线性回归模型 一、模型变量的直接代换 二、模型变量的时接代换 第二节 虚拟变量 一、时间序列资料问题虚拟的变量的引入 二、横截面资料问题虚拟变量的引入 三、季节变动虚拟变量 四、分组资料虚拟变量 .....第五章 异方差性第六章 序列相关性第七章 多重共线性第八章 随机解释变量第九章 滞后变量模型第十章 联立方程计量经济模型第十一章 几种基本经济函数模型第十二章 计量经济模型的应用附录一 相关系数表附录二 T分布表附录三 F分布表附录四 D-W检验表主要参考文献

## 章节摘录

四、建立生产函数模型过程中的数据质量问题 1. 一致性 建立生产函数模型选用的样本数据有时间序列数据和横截面数据。

无论选择哪种数据,都要特别注意一致性问题。

如果选用时间序列数据,解释变量之间往往存在多重共线性,利用横截面数据可以避免多重共线性的影响。

横截面数据包括产出数据、劳动力数据和资金数据,在三种数据选取时要保证一致性。

2. 准确性 在生产函数模型估计中,要保证样本数据的准确性,即保证样本数据口径一致。

3. 可比性 在生产函数模型中,要保证样本数据的可比性问题。

如果样本数据存在不可比问题,会造成生产函数的结构参数估计值失真。

五、生产函数举例 根据全国31个省、市、自治区2001年的统计数据资料(表11.4),运用柯布一道格拉斯生产函数研究国有及国有控股企业工业总产值、国有企业资产、国有企业职工人数之间的关系。

四、建立生产函数模型过程中的数据质量问题 1. 一致性 建立生产函数模型选用的样本数据有时间序列数据和横截面数据。

无论选择哪种数据,都要特别注意一致性问题。

如果选用时间序列数据,解释变量之间往往存在多重共线性,利用横截面数据可以避免多重共线性的影响。

横截面数据包括产出数据、劳动力数据和资金数据,在三种数据选取时要保证一致性。

2. 准确性 在生产函数模型估计中,要保证样本数据的准确性,即保证样本数据口径一致。

3. 可比性 在生产函数模型中,要保证样本数据的可比性问题。

如果样本数据存在不可比问题,会造成生产函数的结构参数估计值失真。

五、生产函数举例 根据全国31个省、市、自治区2001年的统计数据资料(表11.4),运用柯布一道格拉斯生产函数研究国有及国有控股企业工业总产值、国有企业资产、国有企业职工人数之间的关系。

.....

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>