

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787030277725

10位ISBN编号：7030277724

出版时间：2010-6

出版时间：科学出版社

作者：庞皓 编

页数：370

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

本书第一版出版以后，受到读者的普遍欢迎，被众多高等学校选作经济管理类专业核心课程的教材，并被国家统计局评为全国优秀统计类教材，2006年暑期受教育部委托，西南财经大学又举办了以本教材内容体系为基础的“全国计量经济学骨干教师培训班”。

经过多年的教学实践，各个学校的教师普遍反映，这是一部很适合中国经济管理类院校使用的计量经济学本科教材。

本书第一版出版以来，两年多就已重印7次，发行近7万册，这是对我们的极大鼓舞。

近年来，我们不断加强计量经济学课程的建设，2005年西南财经大学的计量经济学被评为“国家级精品课程”，本书也成为国家级精品课程的主干教材；2006年教育部确定本书为“普通高等教育‘十一五’国家级规划教材”；2006年本书主编庞皓教授被教育部评为“国家级教学名师”；2008年西南财经大学计量经济学教学团队被评为“国家级教学团队”；2009年西南财经大学的“计量经济学课程着力培养学生创新意识和实证分析能力的综合改革与实践”获得国家级教学成果二等奖。

可以说，这些成果的取得都与本教材的建设密不可分。

为了使本书更加完善，更加适合各个学校教学的需要，我们结合计量经济学本科教学和课程建设的体会，并广泛征求校内外师生的意见，由各章的原作者对本书进行了修订。

本次修订遵循的基本原则如下：1) 继续坚持“重思想、重方法、重应用”的课程教学理念。

计量经济学是理论性和实践性都很强的课程，计量经济方法是为解决实际经济问题服务的工具，方法手段要服从经济活动的本质特征。

实践证明，这样的教学理念是符合中国经济管理类各专业本科计量经济学教学实际的。

2) 继续坚持原教材的基本内容体系。

对原版中某些表述不很确切之处加以补充修改，对少数内容作了调整，删去了某些在本科教学中很少涉及的内容。

还从实用的角度，适当补充了最基本的模型函数形式设定误差检验、多变量协整检验等内容。

## <<计量经济学>>

### 内容概要

本书是经济管理类本科各专业核心课程的教材。

本书从我国经济管理类各专业教学的实际出发，坚持“重思想、重方法、重应用”的原则，充分借鉴了国内外教材的优点，精选了教学内容，避免了烦琐的数学推导和证明，系统介绍了计量经济学的基本理论、基本思想、基本方法及其应用，涵盖了教育部经济学学科教学指导委员会制定的经济学科本科计量经济学课程基本要求的全部内容。

本书特别突出计量经济学的实际应用，每一章都有实际的经济案例，与普遍应用的EViews软件紧密结合，并且专门讨论了应用计量经济学方法作实证项目研究的一般方法。

本书适用于经济管理类各专业教师和本科学学生，也特别适合自学计量经济学的读者阅读。

## <<计量经济学>>

### 作者简介

庞皓 1943年生，西南财经大学原副校长、教授、博士生导师。  
先后任教育部经济学类学科教学指导委员会副主任委员、中国统计学会和中同数量经济学会常务理事、中国国民经济核算研究会副会长、中国统计教育学会副会长、四川省数量经济学会理事长。  
1991年被中国人民银行授予“

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第二版前言 第一版前言 第一章 导论 第一节 什么是计量经济学 第二节 计量经济学的研究步骤 第三节 变量、参数、数据与模型 本章小结 思考题 第二章 简单线性回归模型 第一节 回归分析与回归函数 第二节 简单线性回归模型参数的估计 第三节 拟合优度的度量 第四节 回归系数的区间估计和假设检验 第五节 回归模型预测 第六节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录2.1 简单线性回归最小二乘估计有效性的证明 附录2.2 最小二乘估计的证明 第三章 多元线性回归模型 第一节 多元线性回归模型及古典假定 第二节 多元线性回归模型的估计 第三节 多元线性回归模型的检验 第四节 多元线性回归模型的预测 第五节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录3.1 多元线性回归最小二乘估计最小方差性的证明 附录3.2 残差平方和 的均值为( ) 的证明 第四章 多重共线性 第一节 什么是多重共线性 第二节 多重共线性产生的后果 第三节 多重共线性的检验 第四节 多重共线性的补救措施 第五节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 第五章 异方差性 第一节 异方差性的概念 第二节 异方差性的后果 第三节 异方差性的检验 第四节 异方差性的补救措施 第五节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录5.1 对数变换后残差为相对误差的证明 第六章 自相关 第一节 什么是自相关 第二节 自相关的后果 第三节 自相关的检验 第四节 自相关的补救 第五节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录6.1 存在自相关时参数估计值方差的证明 第七章 分布滞后模型与自回归模型 第一节 滞后效应与滞后变量模型 第二节 分布滞后模型的估计 第三节 自回归模型的构建 第四节 自回归模型的估计 第五节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 第八章 虚拟变量回归 第一节 虚拟变量 第二节 虚拟解释变量的回归 第三节 虚拟被解释变量 第四节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 第九章 设定误差与测量误差 第一节 设定误差 第二节 设定误差的检验 第三节 测量误差 第四节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录9.1 概率极限性质的证明 附录9.2 参数 一致性的证明 附录9.3 有测量误差模型参数估计结果的推导 第十章 时间序列计量经济模型 第一节 时间序列计量经济分析的基本概念 第二节 时间序列平稳性的单位根检验 第三节 协整 第四节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 第十一章 联立方程组模型 第一节 联立方程模型及其偏倚 第二节 联立方程模型的识别 第三节 联立方程模型的估计 第四节 案例分析 本章小结 思考题 练习题 附录11.1 联立方程偏倚的证明 第十二章 实证项目的计量经济研究——课程论文分析 第一节 实证项目研究的选题 第二节 模型设定与数据处理 第三节 计量经济分析 附录12.1 实证项目研究(课程论文)示例主要参考文献 附录 统计用表 表1 标准化正态分布下的面积 表2 t分布的百分点 表3 F分布的上端百分点 表4  $\chi^2$ 分布的上端百分点 表5 (a)德宾-沃森d统计量(在0.05显著性水平上 $h$ 和 $du$ 的显著点) 表5 (b)德宾-沃森d统计量(在0.01显著性水平上 $h$ 和 $du$ 的显著点) 表6 协整检验临界值表

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

计量经济学与其他西方经济理论不同的一个重要特点，是它自身并没有固定的经济理论，计量经济学中的各种计量方法和技术，大多来自数学和统计学。

我们只要坚持以科学的经济理论为指导，紧密结合中国经济的实际，就能够使计量经济学的理论与方法在中国的经济理论研究和现代化建设中发挥重要的作用。

20世纪70年代以来，计量经济学的理论和应用又进入一个新的阶段。

首先是计算机的广泛应用和新的计算方法大量提出，计量经济模型的规模越来越大。

更重要的是，非经典计量经济学的理论和应用有了新的突破。

经典计量经济学一般指20世纪70年代以前发展起来并广泛应用的计量经济学，其特征是：主要采用随机模型，以经济理论导向建立模型，变量之间的关系为线性或可转化为线性的因果模型，数据为时间序列数据或截面数据，以最小二乘或极大似然法估计参数，应用于结构分析、政策评价、经济预测。

非经典计量经济学一般指20世纪70年代以后发展的计量经济学，在模型类型、模型导向、模型结构、数据类型、估计方法等方面形成了新的体系。

非经典计量经济学中非线性方法、协整理论、面板数据、非均衡理论、随机过程方法、非参数方法等现代数学和统计理论的应用成为新的研究课题，主要包括微观计量经济学、非参数计量经济学、时间序列计量经济学和动态计量经济学等。

需要强调，经典计量经济学是计量经济学重要的理论和方法论基础，不应当忽视。

非经典计量经济学是对经典计量经济学的完善和发展，对“非经典”的某些新发展应有一定了解，才能把握现代计量经济学的发展，也才能正确理解和运用经典计量方法。

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>