

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787040164305

10位ISBN编号：7040164302

出版时间：2005-04-01

出版时间：高等教育出版社

作者：李子奈

页数：380

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>

## <<计量经济学>>

### 前言

高等学校经济学类核心课程和工商管理类核心课程是在高等教育面向21世纪教学内容和课程体系改革计划“经济学类专业课程结构、共同核心课程及主要教学内容改革研究与实践”和“工商管理类专业课程结构及主要教学内容改革研究与实践”两个项目调研基础上提出、经经济学学科教学指导委员会和工商管理类学科教学指导委员会讨论通过、教育部批准的必修课程。

其中，经济学类各专业的核心课程共8门：政治经济学、西方经济学、计量经济学、国际经济学、货币银行学、财政学、会计学、统计学；工商管理类各专业的核心课程共9门：微观经济学、宏观经济学、管理学、管理信息系统、会计学、统计学、财务管理、市场营销学、经济法。

这些课程确定后，教育部高教司组织有关专家制定了各门课程的教学基本要求，并组编了相应的各门教材。

各门课程的教学基本要求及教材由高等教育出版社于2000年秋季出齐，供各高等学校选用。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 内容概要

《面向21世纪课程教材：计量经济学（附学习卡）（第2版）》融计量经济学理论、方法与应用为一体；以中级水平内容为主，适当吸收初级和高级水平的内容；以经典线性模型为主，适当介绍一些适用的非经典模型。

全书形成具有特色的内容体系。

全书详细论述了经典的单方程计量经济学模型的理论方法，适当介绍了联立方程计量经济学模型和时间序列计量经济学模型的理论方法，引入了几类扩展的单方程计量经济学模型；在计量经济学应用模型中，以生产函数模型、需求函数模型、消费函数模型和宏观计量经济学模型为例，介绍应用模型的建立与发展。

在详细介绍线性回归模型的数学过程的基础上，各章的重点不是理论方法的数学推导与证明，而是实际应用中出现的实际问题的处理，并尽可能与中国的现实相结合。

《面向21世纪课程教材：计量经济学（附学习卡）（第2版）》既包含了由教育部经济学学科教学指导委员会制定的高等学校经济学科本科发展经济学课程教学基本要求的全部内容，又为学有余力者提供了进一步学习的指南。

适合作为各类高等学校经济、管理学科本科生的教材或教学参考书。

也可供具有一定数学和经济学基础的广大经济管理研究人员和研究人员阅读和参考。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 绪论 § 1.1 计量经济学一、计量经济学二、计量经济学模型三、计量经济学的内容体系四、计量经济学是一门经济学科五、计量经济学在经济学科中的地位 § 1.2 建立计量经济学模型的步骤和要点一、理论模型的设计二、样本数据的收集三、模型参数的估计四、模型的检验五、计量经济学模型成功的三要素六、计量经济学应用软件介绍 § 1.3 计量经济学模型的应用一、结构分析二、经济预测三、政策评价四、检验与发展经济理论本章练习题第二章 经典单方程计量经济学模型：一元线性回归模型 § 2.1 回归分析概述一、回归分析基本概念二、总体回归函数三、随机干扰项四、样本回归函数 § 2.2 一元线性回归模型的参数估计一、一元线性回归模型的基本假设二、参数的普通最小二乘估计(OLS)三、参数估计的最大似然法(ML)四、最小二乘估计量的性质五、参数估计量的概率分布及随机干扰项方差的估计 § 2.3 一元线性回归模型的统计检验一、拟合优度检验二、变量的显著性检验三、参数的置信区间 § 2.4 一元线性回归分析的应用：预测问题一、是条件均值或个别值 $y_n$ 的一个无偏估计二、总体条件均值与个别值预测值的置信区间 § 2.5 实例：时间序列问题一、中国居民人均消费模型二、时间序列问题本章练习题第三章 经典单方程计量经济学模型：多元线性回归模型 § 3.1 多元线性回归模型一、多元线性回归模型二、多元线性回归模型的基本假定 § 3.2 多元线性回归模型的参数估计一、普通最小二乘估计二、最大似然估计三、矩估计(moment method, MM)四、参数估计量的性质五、样本容量问题六、多元线性回归模型的参数估计实例 § 3.3 多元线性回归模型的统计检验一、拟合优度检验二、方程总体线性的显著性检验(F检验)三、变量的显著性检验(t检验)四、参数的置信区间 § 3.4 多元线性回归模型的预测一、 $E(Y_0)$ 的置信区间二、 $y_n$ 的置信区间 § 3.5 可化为线性的多元非线性回归模型一、模型的类型与变换二、可化为线性的非线性回归实例 § 3.6 受约束回归一、模型参数的线性约束二、对回归模型增加或减少解释变量三、参数的稳定性四、非线性约束本章练习题第四章 经典单方程计量经济学模型：放宽基本假定的模型 § 4.1 异方差性一、异方差的类型二、实际经济问题中的异方差性三、异方差性的后果四、异方差性的检验五、异方差的修正六、案例——中国农村居民人均消费函数 § 4.2 序列相关性一、序列相关性二、实际经济问题中的序列相关性三、序列相关性的后果四、序列相关性的检验五、序列相关的补救六、虚假序列相关问题七、案例——中国商品进口模型估计 § 4.3 多重共线性一、多重共线性二、实际经济问题中的多重共线性三、多重共线性的后果四、多重共线性的检验五、克服多重共线性的方法六、案例——中国粮食生产函数 § 4.4 随机解释变量问题一、随机解释变量问题二、实际经济问题中的随机解释变量问题三、随机解释变量的后果四、工具变量法五、案例——中国居民人均消费函数本章练习题第五章 经典单方程计量经济学模型：专门问题 § 5.1 虚拟变量模型一、虚拟变量的引入二、虚拟变量的设置原则 § 5.2 滞后变量模型一、滞后变量模型二、分布滞后模型的参数估计三、自回归模型的参数估计四、格兰杰因果关系检验 § 5.3 模型设定偏误问题一、模型设定偏误的类型二、模型设定偏误的后果三、模型设定偏误的检验 § 5.4 从传统建模理论到约化建模理论一、传统建模理论与数据挖掘问题二、“从一般到简单”——约化建模型理论三、非嵌套假设检验四、约化模型的准则本章练习题第六章 联立方程计量经济学模型理论与方法 § 6.1 联立方程计量经济学模型的提出一、经济研究中的联立方程计量经济学问题二、计量经济学方法中的联立方程问题 § 6.2 联立方程计量经济学模型的若干基本概念一、变量二、结构式模型(structural model)三、简化式模型(reduced-form model)四、参数关系体系 § 6.3 联立方程计量经济学模型的识别一、识别的概念二、结构式识别条件三、简化式识别条件……第七章 经典计量经济学应用模型第八章 扩展的单方程计量经济学模型第九章 时间序列计量经济学模型附录 统计分布表参考文献

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

插图：这里需要考察一下现代经济学，主要是现代西方经济学的特征。

现代西方经济学有许多特征，可以从不同的角度去归纳。

从方法论的角度讲，主要有以下三个方面：一是越来越多地从方法论的角度去阐述和定义经济学；认为“经济学是一种思考社会问题的方法”，“经济学的主要贡献是它的分析框架”，“经济学是一套用以观察无限丰富和多变的世界的工具”；认为经济学是其他社会科学的基础，类似于物理学在自然科学中的地位。

二是愈来愈重视研究方法的科学性，重实证分析，轻规范分析，认为“规范的方法显然是不科学的”，“经济学，对于规范的问题只能保持沉默”，“科学知识的占有尚不具备解决规范问题的能力”，“如果将价值判断引入经济理论，这种理论就不可能成为客观的科学”。

这些认识虽然过于偏激，甚至存在谬误，在我们看来，经济学不能完全排斥规范分析，不能完全否定价值判断，但这些反映了西方经济学把自己定义为一门实证的社会科学的事实。

三是数学的广泛应用已成为一个普遍趋势。

经济学作为一门科学，如果从亚当·斯密1776年的《国富论》算起，也只有200多年的时间。

经济学研究的数学化和量化是经济学迅速科学化的重要标志。

，当然，数学仅仅是一种工具，而不是经济学理论本身。

但正是这种工具，推动了经济学理论的发展，微分学与边际理论、优化方法与最优配置理论和数理统计学与经济学的实证化就是例证。

翻开任何一本经济学教科书或任何一份经济学刊物，无不用数学语言阐述经济理论，用定量的方法描述和讨论人们关心的经济现实问题。

许多世界一流大学的经济学院系在其教学计划的培养目标中，都对学生应用数学工具的能力提出明确要求。

例如，“现代经济学理论的一个显著特点是数学的广泛应用，学生必须学会用数学工具描述和发展经济学理论”，“教学计划的目标之一是教会学生将数学作为经济分析的一个基本工具，去思考和描述经济问题和政策”。

于是，计量经济学成为学生必须学习的核心课程，而且从初级、中级到高级。

以上这些特征，决定了计量经济学在西方经济学中的重要地位。

经济学科是否与许多自然科学学科一样，存在“世界先进水平”？

是，又不是。

讲不是，是指经济学理论与经济政策。

各国国情不同，经济制度与体制不同，所处的发展阶段不同，指导发展的经济理论和实施的经济政策当然不同。

在这方面，不会也不应有“世界先进水平”。

讲是，是指经济学研究方法和经济分析方法存在“世界先进水平”，而在这个方面，我们落后了，而且落后了许多。

<<计量经济学>>

编辑推荐

《计量经济学》为高等教育出版社出版发行。

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>