

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787111250852

10位ISBN编号：7111250850

出版时间：2008-9

出版时间：机械工业

作者：赵卫亚//彭寿康//朱晋

页数：242

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

20世纪70年代以后,计量经济学理论和应用都进入了一个新的发展时期。协整和误差修正模型理论“颠覆”了传统的计量经济学建模思想,促使经济学家应用新的理论建立宏观计量经济模型,侧重分析经济变量之间的长期均衡关系。

ARCH类模型的一系列研究成果也成为目前金融学家分析金融时间序列波动规律的有力工具,并逐渐形成了一个新的交叉学科--金融计量经济学。

随着微观计量经济学理论方法的逐渐成熟,人们开始使用面板数据模型、离散数据模型、受限数据模型分析个人、家庭、企业等微观经济数据所包含的经济信息,研究个体的行为差异及其与影响因素的关系。

这些丰富的开创性成果将计量经济学提升到一个新的水平,所以,人们习惯上将20世纪70年代以后的计量经济学理论称为“现代计量经济学”,而将这之前的计量经济学理论称为“经典计量经济学”。

自1998年教育部经济学学科教学指导委员会将计量经济学确定为经济类专业的核心课程之后,有力地推动了计量经济学教材建设的发展,相继出版了一些优秀教材。

但由于受篇幅和学时的限制,国内本科教材大多数是以经典计量经济学的内容为主,很少涉及(或只是简单介绍)现代计量经济学的内容。

这与目前在宏观计量经济分析、金融计量经济分析和微观计量经济分析中,以现代计量经济学方法为主的现实不吻合。

因此,迫切需要有一本能够融合经典计量经济学和现代计量经济学内容、教学课时适应于本科教学、内容难度能够被经济类专业本科生接受的教材。

正是出于这些考虑,我们编写了这本教材。

本教材在教学内容体系组织上具有以下明显特点:一是注重理论、方法的基本原理和具体应用,尽量避免烦琐的数学推导。

二是精简整合了计量经济学的内容,尽量融合经典计量经济学和现代计量经济学的内容,反映学科的发展趋势;教材中简化了单方程模型的理论推导过程,省略了联立方程模型内容,充实了协整理论和误差修正模型、ARCH类模型、离散数据模型等内容。

三是强调计量经济方法的具体应用,尤其是在金融领域的应用,书中例题和习题数据大多数采用宏观金融和微观金融的实际统计资料,主要章节最后还附有一个综合性的金融案例。

四是以计量经济分析软件--EViews和SAS作为教学支持软件,教学内容中始终贯穿了EViews的具体使用,并根据金融数据的特点介绍了SAS软件的计量经济分析过程,以便学生结合软件操作,理解计量经济学的基本理论和方法,掌握计量经济方法的实际应用。

本教材共分9章。

第1章,绪论,主要介绍计量经济学的研究内容和研究步骤,以及与其他学科之间的关系。

第2章,回归模型,系统介绍了回归分析的基本理论和方法。

考虑到本科学生已经具有概率统计的基础,所以本章内容侧重介绍回归模型的基本假定、估计和检验方法的原理,以及如何评价、筛选回归模型。

第3章,回归模型的扩展,详细讨论了违反回归模型基本假定时所产生的问题,以及描述定性因素影响的虚拟变量模型。

第4章,时间序列模型,详细介绍了ARMA方程模型的建模方法、时间序列平稳性检验方法,以及格兰杰因果关系检验方法。

第5章,协整与误差修正模型,详细介绍了变量之间协整关系的含义与检验方法,以及建立误差修正模型的方法。

第6章,ARCH模型及其扩展,介绍了时间序列波动率模型的建模方法,包括ARCH模型及其扩展形式,ARCH效应检验和ARCH类模型的估计与检验方法。

第7章,离散因变量模型与受限因变量模型,介绍了分类选择模型的估计和检验方法,以及使用受限数据的Tobit模型。

第8章,SAS软件与金融数据分析,介绍了SAS软件的数据处理过程,以及计量经济分析的软件实现过

<<计量经济学>>

程。

第9章，金融实证论文写作，结合金融市场理论介绍了设定计量经济模型的方法，以及实证分析论文的基本结构，为学生撰写课程论文、完成综合性实验过程提供一个指导性的框架。

因此，从全书结构可以看出，第1章至第3章的内容属于经典计量经济学，第4章是一个过渡性章节，第5章至第7章是现代计量经济学的重点内容，而第8章和第9章的内容则是为了引导学生进一步提升综合分析能力和解决实际问题的能力。

<<计量经济学>>

内容概要

注重理论、方法的基本原理和具体应用，尽量避免烦琐的数学推导；精简整合了计量经济学的内容，简化了单方程模型的理论推导过程，省略了联立方程模型内容，充实了协整理论和误差修正模型、ARCH类模型、离散数据模型等内容；强调计量经济方法的具体应用，尤其是在金融领域的应用；以计量经济分析软件——EViews和SAS作为教学支持软件，教学内容中始终贯穿了EViews的具体使用，并根据金融数据的特点介绍了SAS软件的计量经济分析过程。

《计量经济学》可以作为高等院校经济管理类本科各专业的计量经济学课程教材，也可以作为非计量经济学专业研究生的辅助教材，还可以作为经济管理部门、金融业技术分析人员的计量经济学自学教材或参考书。

<<计量经济学>>

书籍目录

出版前言前言教学建议第1章绪论/11.1什么是计量经济学/21.2计量经济学与其他学科的关系/31.3计量经济研究的步骤/41.4计量经济学的发展/81.5计量经济分析软件/11本章小结/19思考与练习/20第2章回归模型/212.1回归分析概述/222.2一元线性回归模型/252.3多元线性回归模型/312.4回归模型的统计检验/372.5预测/442.6非线性回归模型/49案例分析：伦敦铜期货价格模型/53本章小结/55思考与练习/56第3章回归模型的扩展/583.1异方差性/593.2自相关性/723.3多重共线性/883.4虚拟变量/103案例分析：香港恒生指数影响因素分析模型/112本章小结/119思考与练习/119第4章时间序列模型/1244.1随机时间序列模型概述/1254.2时间序列的平稳性及其检验/1284.3时间序列的格兰杰因果检验/133案例分析：银行股与上证指数的因果关系检验/135本章小结/138思考与练习/138第5章协整与误差修正模型/1405.1变量的协整关系与协整检验/1405.2误差修正模型/149案例分析：我国金融发展与经济增长的协整分析/152本章小结/155思考与练习/156第6章ARCH模型及其扩展形式/1586.1ARCH模型及其扩展形式概述/1596.2ARCH效应检验/1656.3GARCH类模型的估计与检验/170案例分析：GARCH类模型在金融领域的应用/176本章小结/181思考与练习/181第7章离散因变量模型与受限因变量模型/1837.1线性概率模型及其存在的问题/1847.2Logistic回归和Probit过程/1867.3排序选择模型/1967.4Tobit模型/200本章小结/204思考与练习/205第8章SAS软件简介与金融数据分析/2078.1SAS系统简介/2078.2SAS系统的数据库/2128.3金融数据分析--回归分析/2188.4金融数据分析--时间序列分析/223本章小结/226思考与练习/227第9章金融实证论文写作/2289.1金融市场理论与计量经济方法/2289.2金融实证论文写作框架/232本章小结/238思考与练习/238附录/239参考文献/243

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>