

<<计量经济学及其应用>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学及其应用>>

13位ISBN编号：9787111298427

10位ISBN编号：711129842X

出版时间：2010-3

出版时间：机械工业出版社

作者：杜江 编

页数：227

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;计量经济学及其应用&gt;&gt;

## 前言

当今社会，“月光族”已经成为一种越来越普遍的现象。

但是，所谓的“月光族”，真的“月光”了吗？

要想搞清楚这种经济现象是否存在，我们可以采用计量经济学方法来检验。

通过建立收入与消费之间的计量经济学模型，采用大量的抽样调查数据，如果在统计意义上得出消费者的边际消费倾向恰好等于1的话，才能称之为严格意义上的“月光族”。

这个有趣的结论仅仅是运用计量经济学解决现实经济问题的无数事例之一。

事实上，在现实社会中，几乎所有的经济问题都可以用计量经济学进行分析和处理，可以说计量经济学在解决各种各样的社会现象和经济现象中起着举足轻重的作用。

目前，我国计量经济学与以往相比有了长足的发展，也出现了很多优秀的教材，但大多数教科书中烦琐的数学公式和理论推导，使得计量经济学这门学科的应用普及还不太广泛。

我们经过深思熟虑后，把这本教材命名为《计量经济学及其应用》，在编纂过程中，我们不仅最大限度地运用数学公式，还采用同一组数据基本上贯穿了所有章节，竭力将计量经济学原理以最直观、最通俗易懂的形式表述出来。

从事计量经济学教学十多年来，我在教学过程中发现，很多学生虽然学习了不少理论方法，但是不知道如何运用这些知识来分析解决实际的经济问题，空有一肚子计量经济学理论知识，而缺乏灵活应用和实际操作的能力，没有真正领悟到计量经济学的内涵所在。

倘若不能将其运用于实际经济问题的解决中，则好比一个人买了一台8G内存的电脑却只用于看电子小说——极好的资源完全没有得到充分的应用。

因此，在本书中，我们十分强调计量经济学方法的实际应用，每讲述完一种计量经济学理论方法，都详尽地介绍了相应的Eviews软件操作方法和步骤，并在此基础上，通过一些精选出来的案例使读者能够更直观地了解如何将计量经济学运用到现实经济生活中去。

总的来说，本书立足于计量经济学的基本理论思想，本着通俗易懂的原则，深入浅出，将数学公式的运用最少化，注重理论和方法的具体应用，使读者在阅读后可以比较容易地领悟到计量经济学原理的思想内涵，掌握计量经济学最基本的研究方法，学会如何使用计量经济学软件分析解决现实的经济问题。

这是一本让人读了就会懂、懂了就会用，兼具理论性与实用性的教材。

## <<计量经济学及其应用>>

### 内容概要

本书立足于计量经济学的基本理论思想，本着通俗易懂的原则，将数学公式的运用最少化，注重理论和方法的具体应用。

本书的特色在于，十分强调计量经济学方法的实际应用，每讲述完一个计量经济学理论方法，都详尽地介绍了相应的Eviews软件操作方法和步骤，并在此基础上，通过一些精选出来的案例，使读者能够真正掌握计量经济学最基本的研究方法，学会如何使用计量经济学软件分析解决现实的经济问题。

本书适合高等院校经济学及相关专业本科生、研究生使用。

## &lt;&lt;计量经济学及其应用&gt;&gt;

## 书籍目录

前言	教学建议	绪论	0.1 什么是计量经济学	0.2 为什么要学习计量经济学	0.3 如何学习计量经济学
0.4 计量经济学方法	思考与练习	第一篇 经典假设下的计量经济学模型	第1章 Eviews软件简介与数据处理方法	1.1 Eviews软件简介	1.2 数据分类
1.3 数据获取	1.4 数据处理	1.5 数据的统计特征	思考与练习	第2章 最小二乘法	2.1 散点图
2.2 函数的形式与参数的经济意义	2.3 最小二乘法	2.4 案例分析	思考与练习	第3章 一元线性回归	3.1 传统假设下的一元线性回归模型
3.2 一元线性回归模型的基本假设	3.3 最小二乘估计值的特征	3.4 判定系数	3.5 最小二乘回归的若干重要结论	3.6 参数显著性检验：t检验	3.7 预测
3.8 案例分析	思考与练习	第4章 多元回归分析（一）	4.1 多变量线性回归模型	4.2 多元线性回归模型的若干假设	4.3 多元线性回归模型的参数估计
4.4 多元回归模型的拟合优度	4.5 多元线性回归模型的参数检验	4.6 多元线性回归模型的预测	4.7 案例分析	思考与练习	第5章 多元回归分析（二）
5.1 带有虚拟变量的回归模型	5.2 参数的标准化	5.3 非标准线性模型的标准化	5.4 案例分析	思考与练习	第二篇 放宽假设的计量经济学模型
第6章 异方差性	6.1 什么是异方差性	6.2 异方差产生的后果	6.3 异方差性的诊断	6.4 如何消除异方差	6.5 案例分析
思考与练习	第7章 序列相关性	7.1 什么是序列相关性	7.2 序列相关性会产生什么后果	7.3 序列相关性的诊断	7.4 如何消除序列相关性
7.5 案例分析	思考与练习	第8章 多重共线性	8.1 什么是多重共线性	8.2 多重共线性会产生什么后果	8.3 多重共线性的诊断
8.4 如何消除多重共线性	8.5 案例分析	思考与练习	第三篇 联立方程模型的理论及其应用	第9章 联立方程模型和识别	9.1 联立方程模型的概念
9.2 结构式模型与简化式模型	9.3 模型识别以及识别方法	9.4 案例分析	思考与练习	第10章 联立方程模型的参数估计方法	10.1 普通最小二乘法与递归模型
10.2 间接最小二乘法	10.3 二阶段最小二乘法	10.4 案例	思考与练习	第四篇 时间序列计量经济学模型及其应用	第11章 时间序列的平稳性及其检验
11.1 时间序列数据的平稳性	11.2 时间序列数据的平稳性检验	11.3 ADF单位根检验实例	思考与练习	第12章 向量自回归模型及其应用	12.1 向量自回归模型
12.2 向量自回归模型的估计	12.3 脉冲响应函数	12.4 预测误差方差分解	12.5 Granger因果关系检验	12.6 案例分析	思考与练习
第13章 协整与误差修正模型	13.1 协整理论	13.2 误差修正模型	13.3 向量误差修正模型	13.4 案例分析	思考与练习
附录A 常用年鉴	附录B 标准正态分布表	附录C t分布表	附录D $\chi^2$ 分布百分位数表	附录E F分布百分位数表	附录F 杜宾-沃森检验临界值表
附录G ADF分布临界值表	附录H $\rho$ 的经验分布表	参考文献			

## <<计量经济学及其应用>>

### 章节摘录

插图：第4步：计量经济学模型的参数估计参数估计是计量经济学的核心内容。

在建立了计量经济学模型，并收集到模型所需要的所有数据后，就应该选择采用适当的方法来对参数进行估计。

例如，我们需要对模型（0-2）的参数  $\beta_0$  和  $\beta_1$  进行估计。

参数估计是纯技术过程，包括对模型识别问题的研究、解释变量相关程度的研究、估计方法的选择、计量经济学应用软件的操作等。

常用的参数估计方法有普通最小二乘法（OLS）、加权最小二乘法（WLS）、间接最小二乘法（ILS）、二阶段最小二乘法（2SLS）等。

第5步：计量经济学模型的检验当模型的参数估计出来后，可以认为得到了一个计量经济学模型的初步结果。

但它能否客观反映经济问题中相关经济变量之间的关系，能否具有指导作用，必须通过对模型的检验才能确定。

一般来说，对模型的检验主要分为以下4个方面：（1）经济意义的检验。

即检验参数估计值的符号和大小是否符合应有的经济意义，例如，对于模型（0-2），是否满足人们的理论预期 $\beta_0$

## <<计量经济学及其应用>>

### 编辑推荐

《计量经济学及其应用》：表达更为通俗易懂。

本教材先采用较为简单的模型进行推导，而后循序渐进、由浅入深，是一本让人读了就会懂、懂了就会用，兼具理论性与实用性的教材。

更注重计量经济学软件的运用。

每讲述完一个计量经济学理论方法，都详尽地介绍了相应的Eviews软件操作方法和步骤。

更丰富的案例分析。

这些案例不仅包括经济学领域，还包括管理学、社会学、心理学等。

每章后的习题更加贴近现实。

<<计量经济学及其应用>>

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>