

<<计量经济学基础>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学基础>>

13位ISBN编号：9787111420767

10位ISBN编号：7111420764

出版时间：2013-5

出版时间：张兆丰 机械工业出版社 (2013-05出版)

作者：张兆丰 编

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>

<<计量经济学基础>>

内容概要

<<计量经济学基础>>

书籍目录

前言 教学建议 第1章导论 1.1 计量经济学的产生与发展 1.2 计量经济学的性质 1.3 计量经济学的研究方法 1.4 数据 1.5 预备知识：统计学基础 本章小结 学习建议 关键术语 思考练习 第2章回归与回归分析 2.1 回归的基本问题 2.2 相关分析 2.3 一元线性回归分析 本章小结 学习建议 关键术语 思考练习 第3章一元线性回归模型 3.1 普通最小二乘法 3.2 样本回归直线的代数性质 3.3 拟合优度的度量 3.4 古典假定 3.5 OLS估计量的统计性质 3.6 参数的检验与区间估计 3.7 预测 3.8 案例分析 本章小结 学习建议 关键术语 思考练习 第4章一元线性回归模型的扩展 4.1 过原点的回归 4.2 对数模型 4.3 倒数模型 4.4 模型函数形式的选择 4.5 案例分析 本章小结 学习建议 关键术语 思考练习 第5章多元线性回归模型 5.1 多元线性回归模型的设定 5.2 多元线性回归模型的估计 第6章多重共线性 第7章异方差 第8章自相关 第9章分布滞后模型与自回归模型 第10章虚拟变量回归 第11章时间序列计量经济模型 第12章联立方程组模型 附录A标准正态分布表 附录B分布表 附录C χ^2 分布表 附录D F分布表 附录E DW检验临界值表 参考文献

<<计量经济学基础>>

章节摘录

版权页：插图：在实际运用中，我们可以先运用EViews计算样本对应的交叉相关系数，然后判断滞后结构和滞后期长度，再运用经验加权法进行估计。

【例9—41我国是一个高储蓄率国家，到2009年年末城乡居民人民币存款余额达到26万多亿元。很多因素都会影响储蓄，但其中最重要的因素是居民收入，为此我们选取1990~2009年我国居民人民币存款增量和GDP增量的数据，用GDP作为居民收入的代表变量来估计其对居民储蓄的影响（数据见教学资源data9—4，数据来源：《中国统计年鉴2010》）。

解：首先运用Eviews估计滞后期长度和滞后结构。

可以使用命令计算交叉相关系数，绘制相关图，可以用两种方法进行计算，见图9—2。

（1）命令。

格式为：`cross Y X`，回车后出现一个对话框，要求选择滞后期长度，可以使用其默认值。

确定后就得到交叉相关系数和相关图；（2）菜单命令。

打开两个变量的序列组文件，选择Views / cross correlation（2）后会出现一个对话框，要求选择滞后期长度，可以使用其默认值。

确定后就得到交叉相关系数和相关图。

两种方法的结果是一样的：相关图的含义是：第1列，表示Y与X各滞后期的相关系数的图形，用条形表示，两条虚线表示95%置信水平的区间，左侧为负，右侧为正，条形超过虚线意味着存在线性相关；第2列，表示Y与X领先各期的相关系数的图形；第3列， i 表示滞后期数；第4列，表示Y与X各滞后期的相关系数的数值；第5列，表示Y与X领先各期的相关系数的数值。

<<计量经济学基础>>

编辑推荐

<<计量经济学基础>>

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>