

<<计量经济学（上）>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学（上）>>

13位ISBN编号：9787301145296

10位ISBN编号：7301145292

出版时间：2009-1

出版时间：默里 (Michael P.Murray) 北京大学出版社 (2009-01出版)

作者：默里

页数：511

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（上）>>

### 前言

本书特色：不同于传统教材以最小二乘法开始教学的做法，本书从一个蒙特卡罗模拟练习开始，一方面避免了因学生不理解样本分布而带来的问题；另一方面，通过将学生的注意力集中在重复样本的估计量的差异，使学生从学习之初即像计量经济学家那样思考。

在介绍异方差、变量误差和一致性等问题时，本书再次引入了蒙特卡罗方法。

在本书的配套网站上可以获得相应的程序以及蒙特卡罗模拟的指南，使学生能够自行建立蒙特卡罗模型并得出结果“回归的经典成就”（Regression's Great Hits）专栏提供了一系列学生可以模仿的计量分析，这些经典的实例包括学生熟悉的恩格尔曲线的建立、CAPM模型的检验、对理性预期假设的支持等，从而帮助学生在计量经济学和经济学理论之间建立清晰的联系，完成从理论经济学到计量经济学的跳跃，并阐释了计量经济学的技术如何能够获得实用的、意义深远的或者有趣的结论，向学生展示了计量经济学研究如何能够丰富经济学的重要知识。

本书在正文中应用了大量的现实数据，全书以经济行为为前提，以理论量化经济关系，关注理论在现实生活的应用。

本书内容丰富，既可用于入门教材，亦可用于具备经济学和统计学背景的学生的高级教材，可供教师根据不同教学目的灵活取舍。

## <<计量经济学（上）>>

### 内容概要

《计量经济学：现代方法(上)》覆盖了计量经济学的所有重要内容。

全书采用了循序渐进的方式激发学生学习计量经济学的兴趣，注重使学生在在学习之初便学会像计量经济学家那样去思考。

全书结合经济学理论，给出了计量经济学应用的大量实例，包括恩格尔曲线、菲利普斯曲线、理性预期假设的检验等经典例子。

上册包括线性回归模型的重要内容，如估计量的选择、模型设定、假设检验、异方差扰动项及自回归扰动项等，适用于一学期的计量经济学课程。

不同于传统教材以最小二乘法开始教学的做法，《计量经济学：现代方法(上)》从一个蒙特卡罗模拟练习开始，方面避免了因学生不理解样本分布而带来的问题；另一方面，通过将学生的注意力集中在重复样本的估计量的差异，使学生从学习之初即像计量经济学家那样思考。

“回归的经典成就”（Regression ' S Great Hits）专栏提供了一系列学生可以模仿的计量分析，以帮助学生在计量经济学和经济学理论之间建立清晰的联系，完成从理论经济学到计量经济学的跳跃，并向学生展示了计量经济学研究如何能够丰富经济学的重要知识。

《计量经济学：现代方法(上)》在正文中应用了大量的现实数据，全书以经济行为为前提，以理论量化经济关系，关注理论在现实生活中的应用。

<<计量经济学（上）>>

作者简介

作者：(美国)默里 (Michael P.Murray) Michael P.Murray. Bates学院 ( Bates College ) 经济学系查尔斯·富兰克林·菲利普斯(Charles Franklin Phillips)讲座教授，曾在加州大学圣地亚哥分校(UCSD)、杜克大学(Duke University)等学校任教。

Murray教授的主要研究领域为贫困问题，就美国的转移支付和不发达国家的产业区位政策等有大量著述，讲授城市经济学、公共经济学，发展经济学、微观经济理论和计量经济学等课程。

Murray教授现任Journal of Economic Education编委，并曾担任世界银行、美国海军和兰德公司顾问。

<<计量经济学（上）>>

书籍目录

第一部分 线性回归模型第1章 什么是计量经济学？

第2章 估计量的选择：直觉与蒙特卡罗方法第3章 线性估计量和高斯—马尔可夫定理第4章 直线斜率和截距的BLUE第5章 残差第6章 多元回归第二部分 设定与假设检验第7章 回归模型中的单一假设检验第8章 冗余变量和省略变量、多重共线性，以及二元变量第9章 多重假设检验第三部分 回归模型的进一步讨论第10章 异方差扰动项第11章 自回归扰动项

<<计量经济学（上）>>

章节摘录

插图：

## <<计量经济学（上）>>

### 编辑推荐

《计量经济学:现代方法(上)》内容丰富,既可用作入门教材,亦可用作具备经济学和统计学背景的学生的高级教材,可供教师根据不同教学目的灵活取舍。

<<计量经济学（上）>>

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>