

<<计量经济学理论与方法>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学理论与方法>>

13位ISBN编号：9787302232261

10位ISBN编号：7302232261

出版时间：2010-8

出版时间：清华大学

作者：殷红//金永红

页数：297

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>

<<计量经济学理论与方法>>

前言

计量经济学是一门有魅力的经济学科，它严谨、逻辑性强。

计量作为理论与现实的桥梁，使得对经济问题的探讨脱离了简单的宏观定性讨论，变得更加科学，讨论领域也更加宽广。

计量经济学也是教育部面向21世纪课程体系改革方案确定的经济类专业核心课程之一，是经济类专业学生必修的考试课程，具有综合性、实证性、方法论、能力型的特点。

本教材是我们在长期开设计量经济学课程的基础上，针对普通本科院校经济及管理类专业高年级学生计量经济学课程要求而编写的。

从2005年开始教授计量经济学课程以来，我们一直找不到一本合适的教科书，目前市面上的教材中虽然不乏优秀之作，但这些教材在运用于实际教学时还存在一些问题。

(1) 教材难度两极分化。

国内一些知名高校出版和采用的计量经济学教材普遍偏重于理论，充斥着大量的数学推导，作为一种分析工具，这不易被经济管理类学生所掌握，为此，我们在教学中不得不花费大量的时间举例说明计量经济学是一门实用性非常强的经济学科，解释理论、方法与应用的关联性。

而另一些应用型的教材虽然大大简化了烦琐的数学推导，偏重于方法和软件的应用，但由于对计量方法的理论介绍过于简单，使得学生在应用计量工具时“只知其然，而不知其所以然”。

<<计量经济学理论与方法>>

内容概要

《计量经济学理论与方法》共12章，前8章为经典计量经济学的内容，后4章介绍现代计量经济学的重要理论模型及其应用。

《计量经济学理论与方法》精简整合了计量经济学的内容，系统介绍了单方程模型的理论与方法，提供了必要的数学推导；省略了联立方程模型内容，并充实了虚拟变量建模方法及其应用；适当引入了现代计量经济学的重要理论，包括协整理论和误差修正模型、ARCH类模型、离散数据模型等；强调了计量经济方法在经济、金融、管理领域的具体应用；以计量经济分析软件——EViews作为教学支持软件；并配套习题及模拟试题。

《计量经济学理论与方法》既可作为高等院校经济管理类专业高年级本科教材，也可作为非计量经济学专业研究生的辅助教材，还可作为经济管理类人员学习、应用计量经济学的参考书。

<<计量经济学理论与方法>>

作者简介

殷红，博士，现为华东师范大学商学院经济系讲师，近年来一直从事计量经济学相关方面的教学和科研工作。

主持国家社会科学基金项目1项，在核心期刊发表论文10多篇，出版学术专著1部。

金永红，博士，副教授，现为华东理工大学商学院金融创新研究中心主任，硕士生导师。

目前主要从事风险投资、资本运营和金融工程等方面的研究和实务工作。

主持包括国家社会科学基金在内的省部级以上纵向课题10余项，企业委托横向项目10余项。

在核心期刊发表学术论文50余篇，出版专著和教材5部、译著4部。

<<计量经济学理论与方法>>

书籍目录

第一章 绪论1.1 什么是计量经济学1.2 为什么要学习计量经济学1.3 计量经济学的发展1.4 计量经济学的研究步骤本章思考题第二章 一元线性回归模型2.1 回归分析概述2.2 参数的最小二乘估计2.3 估计量的统计性质及分布2.4 一元线性回归模型的检验2.5 案例分析本章思考题第三章 多元线性回归模型3.1 二元线性回归模型概述3.2 多元回归模型及基本假定3.3 多元回归模型的参数估计3.4 多元回归模型的拟合优度3.5 多元回归模型的统计检验3.6 多元回归模型的预测3.7 案例分析本章思考题第四章 回归模型的函数形式4.1 对数线性模型4.2 半对数模型4.3 双曲函数模型4.4 多项式回归模型4.5 案例分析本章思考题第五章 异方差5.1 异方差的性质5.2 异方差的后果5.3 异方差的检验5.4 异方差的修正5.5 案例分析本章思考题第六章 自相关6.1 自相关产生的原因6.2 自相关的后果6.3 自相关的诊断6.4 自相关的修正6.5 案例分析本章思考题第七章 多重共线性7.1 多重共线性的性质7.2 多重共线性的后果7.3 多重共线性的检验7.4 多重共线性的解决方法7.5 案例分析本章思考题第八章 虚拟变量建模8.1 虚拟变量的加法引入8.2 虚拟变量的乘法引入8.3 虚拟变量模型的应用本章思考题第九章 分布滞后模型与自回归模型9.1 滞后效应9.2 分布滞后模型与自回归模型9.3 分布滞后模型的估计9.4 自回归模型的估计9.5 案例分析本章思考题第十章 协整与误差修正模型10.1 平稳时间序列及检验10.2 协整及误差修正模型10.3 Granger因果性检验10.4 案例分析本章思考题第十一章 ARCH模型及其扩展形式11.1 ARCH模型11.2 GARCH模型11.3 GARCH模型的扩展形式11.4 案例分析第十二章 离散因变量与受限因变量模型12.1 线性概率模型12.2 对数单位模型12.3 概率单位模型12.4 托比模型12.5 案例分析附录A 有关数学证明附录B 数理统计学基础知识附录C 分布临界值表附录D EViews的基本操作计量经济学模拟试卷参考文献

<<计量经济学理论与方法>>

章节摘录

计量经济学模型被广泛地应用于经济学、金融学、管理学以及营销学等各个领域，它的功能大体可以被概括为四个方面：结构分析、经济预测、政策评价、检验与发展经济理论。

结构分析。

经济学中的结构分析是对经济现象中变量之间相互关系的研究。

它不同于人们通常所说的，诸如产业结构、产品结构、消费结构、投资结构中的结构分析。

它研究的是当一个变量或几个变量发生变化时会对其他变量以至经济系统产生什么样的影响，从这个意义上讲，我们所进行的经济系统定量研究工作，说到底就是结构分析。

经济预测。

计量经济学模型作为一类经济数学模型，是从用于经济预测特别是短期预测而发展起来的。

在西方国家经济预测中不乏成功的实例，计量经济学模型一直是经济预测的一种主要模型方法。

政策评价。

从宏观经济领域到微观经济领域，每时每刻都存在政策评价的问题。

经济政策具有不可试验性，这就使得政策评价显得尤其重要。

经济数学模型可以起到“经济政策实验室”的作用。

尤其是计量经济学模型，揭示了经济系统中变量之间的相互联系，将经济目标作为被解释变量，经济政策作为解释变量，可以极方便地评价各种政策对目标的影响。

检验与发展经济理论。

一个成功的模型，必须很好地拟合样本数据，而样本数据则是已经发生的经济活动的客观再现，所以在模型中表现出来的经济活动的数量关系，则是经济活动所遵循的经济规律，即理论的客观再现。

这就提出了计量经济学模型的两方面功能。

一是按照某种经济理论去建立模型，然后用表现已经发生的经济活动的样本数据去拟合。

如果拟合得好，则这种经济理论得到了检验，这就是检验理论。

二是用表现已经发生的经济活动的样本数据去拟合各种模型，拟合最好的模型所表现出来的数量关系，则是经济活动所遵循的经济规律，这就是发现和发展理论。

<<计量经济学理论与方法>>

编辑推荐

《计量经济学理论与方法》特色精简整合了计量经济学的内容。

教学课时量适中，内容难度适当。

注重实际案例分析。

增加最新研究进展。

理论阐述由浅入深。

EViews软件辅助教学。

配套习题及模拟试题。

丛书介绍：“B & E”（Business & Economics）系列包括了工商管理核心课程、经济学、金融学、会计学、财务学、营销学、管理学等各子系列，出版规模将超过百本，可谓“百门精品教材”。

“百门精品教材”坚持“新观念与本土化”的创作思想，力图与海外教材接轨，既有海外经典教材的严密逻辑，又结合中国的实际，配有丰富的中国本土案例。

<<计量经济学理论与方法>>

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>