

<<计量经济学理论与实践>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学理论与实践>>

13位ISBN编号：9787302270355

10位ISBN编号：730227035X

出版时间：2012-1

出版时间：清华大学出版社

作者：袁建文，李宏，王克林 著

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;计量经济学理论与实践&gt;&gt;

## 前言

现实的经济世界是一个非常复杂的大系统，这一经济系统包含了居民、企业、政府等部门的经济主体，而这些经济主体的经济行为会遇到许多冲突和问题，面临着许多的选择。例如，居民要决定他们的消费、企业要决定它们的投资、政府要制定货币政策等。各种经济主体进行决策时，要考虑许多相关因素的影响，并对这些因素进行定量分析；计量经济学则可以帮助我们寻找各因素之间的关系，从而为经济主体作出决策时提供数量依据。

计量经济学作为研究经济问题的方法论课程，在我国高等院校的统计学、经济学和管理学等相关专业中开设已有20多年的历史，在经济管理类人才培养中发挥了重要作用。

1998年7月，计量经济学被教育部确定为经济学类各专业的8门核心课程之一，与微观经济学和宏观经济学一起成为经济学科的重要组成部分；此后，计量经济学受到经管类专业越来越多的关注和重视。

经过20多年的发展，计量经济学的教学有了长足的进步，不仅引入了许多国外计量经济学教材，而且国内也编写了不少教材与教辅资料。

但是，以往的计量经济学教学大多以推导证明为主，教学与应用脱节；针对此现状，我们创造性地编写了《经济计量学实验》，引领了全国计量经济学实验教学。

目前，计量经济学理论教材和实验教材不匹配的现象还存在，本教材的编写就是要解决这个问题。

本教材以计量经济学理论为主，强调应用和实验实践环节，培养应用能力和强化操作训练。本教材的主要特色如下。

(1) 坚持“基础性与前沿性相结合”的原则。

计量经济学理论方法按内容深度一般分为初级、中级和高级三个层次。

初级以经典线性单方程计量经济模型理论与方法为主要内容，中级以矩阵描述的经典线性单方程计量经济模型理论与方法、经典线性联立方程模型理论与方法为主要内容，高级以微观计量经济学、非参数计量经济学和动态计量经济学等非经典计量经济学理论与方法为主要内容。

本教材按照基础性与前沿性相结合的指导原则精选教学内容，重新设计本科计量经济学教学内容体系，重点介绍经典单方程计量经济模型理论与方法等基础内容，适当引入时间序列计量经济模型等非经典的计量经济学理论与方法，使读者在掌握计量经济学基础理论与方法的同时对整个学科内容及最新发展有一个全面的了解。

(2) 坚持“重思想、重方法”的原则。

计量经济学是经济学的一个分支，是在数理经济学、经济统计学和数理统计学基础上发展起来的一门经济学学科；计量经济学理论与方法的建立需要一定的高等数学知识，特别是数理统计知识，有些计量经济学教材过于数学化，以至于不能突出计量经济学的研究思想与方法，导致教材难以弄懂。

数学过程可以通过自学搞清楚，而思路则要通过教师的引导才能掌握；一旦掌握了思路，再去理解数学过程，则事半功倍；更重要的是，思路反映了理论方法产生和发展的方法论，掌握了方法论，才可能有发展、有创新。

因此，本教材在介绍计量经济学理论与方法时尽量精简复杂的数学推导与证明，特别注重计量经济学的基本思想、经济背景、基本方法的介绍，使之更适应经济管理类专业学生的要求。

(3) 坚持“理论与应用并重”的原则。

计量经济学根据研究对象和内容侧重点的不同可以分为理论计量经济学和应用计量经济学；理论计量经济学以介绍、研究计量经济学理论与方法为主要内容，侧重于计量经济学理论与方法的数学证明与推导，与数理统计联系极为密切；应用计量经济学以建立与应用计量经济模型为主要内容，侧重于运用计量经济学理论与方法解决实际经济问题。

目前，国内外本科阶段的计量经济学教材，大多以介绍计量经济学理论与方法为主，除了一些例题外，几乎没有关于应用的专门章节；于是，计量经济学成为一门孤立的教材，看不到与其他经济学教材之间的联系，更难以理解它在整个经济学教材体系中的地位，甚至会认为它是一门应用数学类教材。

本教材以计量经济学理论为主，辅之以实验和案例，整合计量经济学理论和计量经济学实验，使它们完全融合；实验和案例贯穿计量经济学教学全过程，通过实验和案例能更深入直观地理解和掌握计量

## <<计量经济学理论与实践>>

经济学理论和方法，了解和掌握计量经济分析的步骤和程序，运用计量经济分析专门软件建立简单的计量经济模型分析问题，从而能达到实际应用的目的。

本教材共分十章。

包括计量经济学概论、一元线性回归模型、多元线性回归模型、异方差、自相关、多重共线性、滞后变量模型、虚拟变量模型、联立方程模型和时间序列计量经济模型等内容。

本书的适用对象为非经济学和统计学专业的经济管理类研究生、经济管理类本科生、广大经济研究和管理人员。

## <<计量经济学理论与实践>>

### 内容概要

《二十一世纪普通高等院校实用规划教材·经济管理系列：计量经济学理论与实践》系统地介绍了计量经济学的基本理论和常用方法，包括一元线性回归模型、多元线性回归模型、异方差、自相关、多重共线性、滞后变量模型、虚拟变量模型、联立方程模型、时间序列计量经济模型等，包含了教育部经济学学科教学指导委员会制定的经济学科本科计量经济学课程基本要求的全部内容。

《二十一世纪普通高等院校实用规划教材·经济管理系列：计量经济学理论与实践》特别突出计量经济学的实际应用，以增强学习者的动手能力，每一章都有应用实例，并与计量经济学软件EViews紧密结合。

《二十一世纪普通高等院校实用规划教材·经济管理系列：计量经济学理论与实践》可作为高等学校经济和管理类专业计量经济学课程的本科教材，也可作为非经济学和统计学专业的经济和管理类研究生的教材，以及作为广大经济研究人员和管理人员了解和掌握计量经济分析方法的学习读物。

## 书籍目录

第一章 计量经济学概论第一节 什么是计量经济学一、计量经济学的定义二、计量经济学与其他相关学科的关系三、计量经济学研究的内容与目的第二节 计量经济模型与数据一、计量经济模型二、计量经济分析中的数据第三节 计量经济学研究的一般方法一、根据经济理论建立计量经济模型二、样本数据的收集三、模型参数的估计四、模型的检验五、计量经济模型的应用第四节 计量经济学软件EViews一、EViews简介二、运行EViews三、EViews的窗口四、EViews的主要功能五、关闭EViews六、EViews的求助资源第五节 计量经济学软件EViews的基本概念一、时间序列、工作文件、对象、观察、组、剪贴板和数据文件二、方程、指数平滑、标签、程序、残差、t统计量三、运算符、函数、特殊函数、回归统计@函数、混合@函数思考题第二章 一元线性回归模型第一节 回归分析的几个基本问题一、回归分析的性质二、回归的几个基本概念第二节 一元线性回归模型的估计一、普通最小二乘法二、经典线性回归模型：最小二乘法的基本假定三、最小二乘估计量、的性质及分布四、随机扰动项方差的估计第三节 一元线性回归模型正态条件下的假设检验一、拟合优度与相关系数二、整体性假定及检验三、对单个参数的检验：t检验（P值）第四节 一元线性回归模型的预测一、点预测二、区间预测第五节 EViews软件应用实例一、研究问题二、参数估计三、预测思考与练习题第三章 多元线性回归模型第一节 多元线性回归模型的几个基本问题一、多元线性回归模型的表示二、多元线性回归模型的基本假定三、多元线性回归模型的矩阵表示第二节 偏回归系数的最小二乘估计一、最小二乘估计量二、实例三、最小二乘估计量的性质四、多元判定系数与校正的判定系数五、偏相关系数第三节 参数估计量和随机扰动项的方差估计一、总体参数的估计量二、随机扰动项的方差估计第四节 多元线性回归模型的假设检验一、关于个别偏回归系数的假设检验二、关于总体显著性的假设检验三、对两个回归系数是否相等的检验第五节 多元线性回归模型用于预测一、点预测二、区间预测第六节 回归模型的其他函数形式一、双对数线性模型二、半对数线性模型三、倒数模型四、多项式回归模型五、不同函数形式模型比较思考与练习题第四章 异方差第一节 异方差的性质第二节 异方差的后果第三节 异方差的检验一、图示法--残差的图形检验二、帕克检验三、格莱泽检验四、怀特的一般异方差检验第四节 异方差的修正方法一、误差已知时的异方差的修正方法二、误差未知时的异方差的修正方法三、重新设定模型思考与练习题第五章 自相关第一节 自相关的性质第二节 自相关产生的原因一、惯性二、模型设定误差三、蛛网现象四、滞后效应五、数据加工第三节 自相关的后果第四节 自相关的诊断一、图示法二、杜宾-瓦特森（D.W.）检验三、自回归模型的自相关检验第五节 补救措施一、广义差分法二、如何估计？第六节 广义差分法的应用思考与练习题第六章 多重共线性第一节 多重共线性的概念一、多重共线性的定义二、多重共线性产生的原因第二节 多重共线性的后果一、多重共线性的统计后果二、多重共线性的实际后果第三节 多重共线性的检验一、直观判断法二、简单相关系数判断法三、辅助回归检验法四、特征根判定法第四节 多重共线性问题的处理一、剔除引起多重共线性的解释变量二、追加样本信息三、使用非样本先验信息四、模型或变量变换五、使用有偏估计第五节 实例：多重共线性的检验与模型估计一、研究问题--中国民航客运量影响分析二、用OLS法估计模型三、多重共线性的诊断四、多重共线性的修正思考与练习题第七章 滞后变量模型第一节 滞后变量模型的概念一、滞后变量的概念与产生滞后效应的原因二、滞后变量模型的种类第二节 分布滞后模型的估计一、分布滞后模型估计的困难二、分布滞后模型的修正估计方法第三节 自回归模型的构造一、自适应预期模型二、局部调整模型第四节 自回归模型的估计一、自回归模型估计的困难二、工具变量法三、自回归模型中自相关的检验第五节 格兰杰因果关系检验一、格兰杰因果关系检验理论二、格兰杰因果关系检验实例第六节 实例：滞后变量模型的估计一、研究问题--中国城镇居民消费模型的建立二、自适应预期模型三、分布滞后模型思考与练习题第八章 虚拟变量模型第一节 虚拟变量模型的概念一、虚拟变量模型的设置二、虚拟解释变量的设置原则三、虚拟变量模型的优缺点第二节 变截距的虚拟解释变量模型一、解释变量只有一个定性变量而无定量变量的回归二、解释变量包含一个定性变量和一个定量变量的回归三、解释变量包含两个定性变量和一个定量变量的回归四、交互效应回归第三节 变斜率的虚拟解释变量模型一、乘法方式引入虚拟解释变量的一般形式二、回归模型结构稳定性检验三、分段线性回归第四节 实例：虚拟解释变量模型的估计一、研究问题--中国国民总收入与居民消费的关系二、邹氏结构变化检验三、虚拟解释变量模型思考与练习题第九章 联立方程模型第一节 联立方程模型概述一、联

<<计量经济学理论与实践>>

立方程模型的性质二、联立方程模型的估计问题三、联立方程模型中变量的类型四、联立方程模型的种类  
第二节 联立方程模型的识别一、联立方程模型识别的概念二、联立方程模型识别的类型三、联立方程模型识别的条件  
第三节 联立方程模型的估计一、联立方程模型估计方法概述二、间接最小二乘法三、工具变量法四、二阶段最小二乘法  
第四节 实例：联立方程模型的估计一、研究问题--中国简单宏观经济模型的建立二、模型的识别三、模型的估计  
思考与练习题第十章 时间序列计量经济模型第一节 时间序列计量经济分析概述一、伪回归问题二、时间序列的平稳性三、时间序列的自相关性四、时间序列的动态记忆性  
第二节 时间序列的平稳性检验一、自相关函数检验法二、单位根检验法三、单整、差分平稳与趋势平稳  
第三节 协整分析与误差修正模型一、均衡与协整二、协整检验三、误差修正模型  
第四节 实例：协整检验与误差修正模型的估计一、研究问题--中国城镇居民人均消费误差修正模型的建立二、单整检验三、协整检验四、误差修正模型的建立  
思考与练习题附录 统计分布表参考文献

<<计量经济学理论与实践>>

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>