

<<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：9787310027439

10位ISBN编号：7310027434

出版时间：2007-9

出版时间：南开大学出版社

作者：张晓峒主编

页数：403

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>>

### 前言

本书非常荣幸于2006年被教育部列入“十一五”国家级规划教材系列。

第3版与第2版相比主要有如下一些变化： 1. 新增第11章“模型的诊断与检验”。

原第3章中第3.6节内容并入第11章。

原第11、12章按顺序分别递推为第12、13章。

2. 原书中提示的EViews操作命令以及附录1全部改为以EViews 5.1版本为准介绍。

相应较低版本的EViews操作命令仍参考本书第1版和第2版。

EViews操作只涉及了一些最基本的内容。

若要掌握更全面、详细的EViews操作方法请参考张晓峒著的《EViews使用指南与案例》，机械工业出版社，2007年2月，书号：978.7.111—20747.4。

4. 更换了书中效果不很满意的一些画图。

5. 在“时间序列模型”一章中新增了“Wold分解定理”和“回归与ARMA组合模型”两节。

6. 修改了上一版中的一些文字勘误。

本书的分工是第1、2、8章由张灿教授编写。

第3、4章由冯燕奇教授编写。

第5、10章由马薇教授编写。

附录1由张灿、马薇教授编写。

第6、11、12、13章由张晓峒教授编写。

第7、9章、附录2和附录3由李忠民副教授编写。

全书由张晓峒统纂定稿。

## <<计量经济学基础>>

### 内容概要

全书共分12章。

前10章是经典计量经济学内容。

其中主要介绍一元、多元线性回归模型，可线性化的非线性回归模型，联立方程模型以及当模型的假定条件不成立时对模型的修正措施，如异方差、自相关、多重共线性问题等。

因为时间序列模型也是预测经济变量的一个重要方法，所以第11章介绍时间序列模型。

近20多年来经济变量的非平稳性问题越来越引起人们的注意，并在这方面取得了许多研究成果。

在第12章对这一部分内容作了初步的介绍。

为了便于掌握计量经济学软件TS ( TimeSeriesPrograms ) 的应用，除了在附录1中专门介绍了TIP的主要功能及其使用方法外，还在各章中对典型的应用给出TIP命令。

在附录2中给出基本的统计学知识，便于读者随时查阅。

书的最后还给出计量经济学专用名词中英文对照表，以便读者进一步阅读英文文献。

为了让读者真正掌握计量经济学知识，在介绍基本理论的同时尽可能多地给出一些例子，并用案例的形式具体介绍计量经济学的应用。

此外，还在第10章专门介绍若干典型的计量经济模型。

## &lt;&lt;计量经济学基础&gt;&gt;

## 书籍目录

第3版前言第2版前言前言第1章 绪论 1.1 计量经济学的定义 1.2 计量经济学的特点 1.3 计量经济学的目的 1.4 计量经济学的内容及研究问题的方法第2章 一元线性回归模型 2.1 模型的建立及其假定条件 2.2 一元线性回归模型的参数估计 2.3 最小二乘估计量的统计性持 2.4 用样本可决系数检验回归方程的拟合优度 2.5 回归系数估计值的显著性检验与置信区间 2.6 一元线性回归方程预测 2.7 小结 2.8 案例分析 思考与练习题第3章 多元线性回归模型 3.1 模型的建立及其假定条件 3.2 最小二乘法 3.3 最小二乘估计量的特性 3.4 可决系数 3.5 显著性检验与置信区间 3.6 关于回归系数的其他检验 3.7 预测 3.8 案例分析 思考与练习题第4章 非线性回归模型的线性化 4.1 变量间的非线性关系 4.2 线性化方法 4.3 案例分析 思考与练习题第5章 异方差 5.1 异方差的概念 5.2 异方差的来源与后果 5.3 异方差检验 5.4 异方差的修正方法——加权最小二乘法 5.5 案例分析 5.6 异方差问题小结 思考与练习题第6章 自相关 6.1 非自相关假定 6.2 自相关的来源与后果 6.3 自相关检验 6.4 自相关的解决方法 6.5 克服自相关的矩阵描述 6.6 自相关系数的估计 6.7 案例分析 思考与练习题第7章 多重共线性 .....第8章 模型中的特殊解释变量第9章 联立方程模型 第10章 几种典型的计量经济模型第11章 模型的诊断与检验第12章 时间序列模型附录1 计量经济分析软件EViews5.1的常用命令、最小二乘估计及预测附录2 推断统计学知识简介附录3 矩阵运算附录4 检验用表附录5 专用名词中英文对照参考文献

## <<计量经济学基础>>

### 编辑推荐

最后还给出计量经济学专用名词中英文对照表，以便读者进一步阅读英文文献。为了让读者真正掌握计量经济学知识，在介绍基本理论的同时尽可能多地给出一些例子，并用案例的形式具体介绍计量经济学的应用。此外，还在第10章专门介绍若干典型的计量经济模型。

<<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>