

<<经济计量学教程>>

图书基本信息

书名：<<经济计量学教程>>

13位ISBN编号：9787503761508

10位ISBN编号：7503761504

出版时间：2010-12

出版时间：中国统计

作者：贺铿

页数：290

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>

<<经济计量学教程>>

内容概要

《经济计量学教程（第2版）》是在前一版《经济计量学教程》（普通高等教育“九五”国家级重点教材）的基础上，结合现代经济学的特征及高等学校本科教学大纲的要求进行全面改编的新教材。

改编后保留了前一版理论结合实际、注重实际应用的特点，同时考虑现代经济计量学的发展和本科教学的需要对教科书的章节做了重大调整，使之更加适合现代经济计量学教学的需要。

本教科书是为高等院校经济类和管理类本科生教学编写的，也适用于研究生和经济计量分析工作者参考，使用。

<<经济计量学教程>>

书籍目录

第一章 绪论1 第一节 经济计量学的产生和发展1 第二节 经济计量学中的基本概念4 第三节 经济计量分析工作9 第二章 经典线性回归模型13 第一节 经典线性回归模型的构建13 第二节 经典线性回归模型参数的估计19 第三节 经典线性回归模型的检验40 第四节 利用经典线性模型进行预测56 第三章 违背经典假定的回归模型62 第一节 异方差62 第二节 序列相关77 第三节 多重共线性92 第四节 随机解释变量、100 第四章 虚拟变量和变参数模型111 第一节 “质”的因素与变参数模型111 第二节 数量因素与变参数模型119 第三节 系统变参数模型121 第四节 虚拟被解释变量模型125 第五章 分布滞后模型134 第一节 分布滞后模型的概念134 第二节 有限多项式滞后模型137 第三节 几何分布滞后模型141 第四节 自回归模型的估计144 第六章 单方程模型设定及应用150 第一节 建模思想150 第二节 模型的选择与评价153 第三节 需求函数和生产函数162 第四节 消费函数和投资函数189 第七章 联立方程模型211 第一节 联立方程模型的一般问题211 第二节 识别问题与识别条件219 第三节 联立方程模型的估计227 第四节 宏观经济计量模型238 第八章 时间序列计量模型247 第一节 时间序列的基本概念247 第二节 单整、趋势平稳与差分平稳随机过程 253 第三节 时间序列模型255 第四节 协整与误差修正模型264 第九章 面板数据模型270 第一节 面板数据模型概述270 第二节 固定效应模型277 第三节 随机效应模型282 主要参考文献290

章节摘录

结构建模理论是传统价格计量模型的主要建模思想，但该方法的局限性也受到经济计量学者们的关注。

该建模方法的缺点如下： 1.经济理论模型的假设与样本数据之间矛盾 经济理论的成立都是依赖于一定的假设条件的，并且描述的都是变量之间的长期均衡关系。

而在经济计量模型的参数估计中所使用的样本数据是实际观测值，是现实系统中各种因素综合作用的结果，并不受经济理论中的假设条件的约束。

直接将样本数据用于模型的参数估计往往会因为数据与理论的矛盾而导致无法获得合理的估计参数，从而得不到理想的模型。

2.模型重新设定存在盲目性 按照结构化建模思想，在未通过检验时，要对模型进行重新设定，直至通过检验。

未能通过检验是因为理论与样本数据的矛盾造成的，因此，经济理论很难提供切实有效的指导去找到正确的模型。

<<经济计量学教程>>

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>