

<<应用计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<应用计量经济学>>

13位ISBN编号：9787504954053

10位ISBN编号：7504954055

出版时间：2010-3

出版时间：中国金融出版社

作者：刘斌，张怀清 著

页数：231

字数：293000

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>

## <<应用计量经济学>>

### 内容概要

本书力图将计量经济理论和实际应用结合起来，在介绍计量经济理论时不过分强调具体的数学推导过程，而在介绍实际操作时强调计量经济的理论支撑，使读者能够在计量经济理论的指导下，针对实际问题设计和使用合理的计量经济模型，提高定量分析能力。

本书具有以下特色：(1)较为详细地讨论建模前的数据处理和模型中的变量选择问题及计量经济模型的选择与比较。

(2)较为详细地介绍模型的求解方法及确定性模拟和随机性模拟的各种方法。

(3)详细讨论预测平台的调整方法及如何将主观判断与模型预测整合起来。

(4)详细介绍VAR模型的各种识别条件、VAR模型与其他模型的比较及VAR模型的其他应用。

(5)详细讨论协整检验及小样本条件下非常有效的Pesaranshin的ARDL方法。

本书可供不同层次计量经济学的学习者使用，也可供从事经济分析和预测的人员参考，特别适合作为在校本科生和研究生的计量经济学教材及参考书。

本书配合各章内容附有练习使用的数据光盘，可供读者上机练习。

## &lt;&lt;应用计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 统计学的基本知识 第一节 随机变量及概率分布 一、随机试验及概率 二、随机变量及累计分布函数 三、随机变量的联合分布 第二节 随机变量的数字特征 一、描述集中趋势的一些特征数 二、描述离散程度的一些特征数 三、描述分布形状的一些特征数 四、协方差及相关系数 第三节 样本数据的一些基本统计量 一、样本均值 二、样本众数、样本中位数及样本百分位数 三、样本方差和标准差 四、样本协方差及样本相关系数 五、样本偏度和样本峰度 第四节 统计假设检验 第五节 常用的统计分布 一、正态分布 二、 $\chi^2$ 分布 三、t分布 四、F分布 五、非中心 $\chi^2$ 分布、t分布和F分布第二章 计量经济模型的设定及建模前的数据处理 第一节 计量经济建模的基本步骤 第二节 模型设定 一、模型设定的理论基础 二、理论结果的数学阐述与函数形式的选择 三、变量的区分与选择 四、模型设定的一个例子 第三节 建模前的数据处理 一、数据的基本分解 二、趋势项的几种处理方法 三、季节调整的几种处理方法 四、不连续数据的处理方法 五、应用实例第三章 单方程模型的估计 第一节 线性回归模型及普通最小二乘法 一、线性回归方程及其假设 二、线性回归方程的普通最小二乘法估计 第二节 普通最小二乘法估计的基本特征 一、线性特征 二、无偏性 三、最小方差性 四、一致性 五、线性回归中丢失重要变量和包含不必要变量产生的问题 第三节 拟合度和方差分析 一、 $R^2$ 的估计 二、拟合度 三、方差分解 第四节 单方程模型的其他估计方法 一、广义最小二乘法 二、二阶段最小二乘法(TSLS) 三、非线性最小二乘法(NLS) 第五节 应用实例第四章 联立方程模型的估计 第一节 联立方程模型及其识别 一、联立方程模型 二、联立方程的识别 第二节 联立方程模型的估计方法 一、普通最小二乘法 二、二阶段最小二乘法(2SLS) 三、三阶段最小二乘法 四、有限信息极大似然估计法 五、全信息极大似然估计法 六、似不相关估计方法(SUR) 七、广义矩(GMM)估计方法 第三节 应用实例第五章 模型检验 第一节 显著性检验 一、一般线性约束的检验 二、常用的几个显著性检验 第二节 异方差性检验 一、White检验 二、Breusch-Pagan-Godfrey检验 三、Goldfeld-Quandt检验 第三节 自相关性检验 一、DW检验 二、Q检验 三、拉格朗日乘子检验 第四节 正态性检验 第五节 稳定性检验 一、模型的结构变化检验 二、模型的稳定性检验 第六节 多重共线性的检验和处理 一、多重共线性的检验方法 二、多重共线性的处理 第七节 应用实例第六章 模型比较与选择 第一节 两种建模思路 第二节 模型的选择与约化 一、约束检验 二、似然函数比例检验 三、信息判据的运用 四、外生性检验 五、模型的约化和选择过程 第三节 模型比较 第四节 应用实例第七章 VAR模型 第一节 VAR模型的基本介绍 一、VAR模型的设定与估计 二、冲击响应分析 三、误差分解 第二节 SVAR模型与冲击的识别 第三节 SVAR模型与其他模型比较 第四节 VAR模型的运用 一、VAR模型在货币政策分析方面的运用 二、VAR模型在其他方面的运用 三、VAR模型与经济预测第八章 非平稳序列模型的建模 第一节 伪回归问题 第二节 数据的平稳性检验 第三节 协整检验 一、Engle-Granger两步检验法 二、Pesaran-Shin的ARDL方法 三、Johansen的极大似然检验法 第四节 误差校正模型 第五节 应用实例第九章 计量经济模型的模拟与情景分析 第一节 模型的基本特征 第二节 模型的求解方法 一、不带有预期变量的线性模型的求解方法 二、带有预期变量的线性模型的求解方法 三、不带有预期变量的非线性模型的求解方法 四、带有预期变量的非线性模型的求解方法 第三节 模拟的类型与方法 第四节 模拟的基本用途 第五节 应用实例第十章 模型与经济预测 第一节 预测的方法和基本原则 第二节 预测的基本框架及步骤 第三节 预测的评价 第四节 模型预测结果的改进与调整 第五节 应用实例

<<应用计量经济学>>

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>