第一图书网, tushu007.com

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787509604625

10位ISBN编号：7509604621

出版时间：2008-12

出版时间：经济管理出版社

作者：杨汭华 编

页数：281

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

前言

计量经济学是经济学研究的基本方法论，是经济学实证研究的技术分析工具。
本教材定位于初、中级计量经济学的难度和内容，面向财经类专业的本科生、自修者以及从事经济量化研究的人士，力求使读者在三个方面得以入门和提高：①掌握计量经济学的基本原理，解决实际经济计量问题的基本思想和方法；②熟练使用EViews计量经济学专用软件，掌握解决实际经济计量问题的工具；③把握计量经济学前沿理论和技术的进展。
另外，本教材强调经济计量理论和经济计量软件的学习相辅相成，理论学习为软件学习的基础，软件学习是理论学习的目的。
本教材的基本框架由四部分构成：①线性回归模型。
本部分以对线性回归模型的基本假定为核心，介绍线性回归模型的设定、估计、检验和应用，并围绕违背统计基本假定的问题探讨多重共线、异方差、自相关和随机解释变量问题。
②线性回归模型的扩展。
本部分将回归模型的数学形式由线性扩展到非线性；将解释变量由经济变量扩展到定性变量；将单一回归模型扩展到联立方程模型；将静态模型扩展到动态模型；将模型估计方法由OLS法扩展到极大似然法、NLS法、RLS法、IV法、GLS法、ILS法、2SLS法和3SLS法等。
并介绍了模型稳定性检验、Granger因果关系检验，等等。
同时介绍了二分变量的Probit、Logit模型，随机时间序列的ECM模型、ARMA模型等前沿性的计量经济学理论和技术。
③主要经济计量模型的应用。
如生产函数模型、成本函数模型、需求函数模型、消费函数模型、投资函数模型等。
④EViews软件的应用。
本教材的特点是：①每章在系统地介绍基本理论的基础上，运用EViews软件处理实际统计资料进行经济计量分析和建模示范；②每章后附有小结及思考与练习题，便于对主要内容及时把握和巩固；③尽量给出经济计量理论中有关结论的数学推导和证明，便于读者理解；④介绍了EViews软件的基本操作和功能，目的是降低读者学习计量经济学的难度，增加学习兴趣并有效地掌握软件的操作运用，提高动手能力。

内容概要

计量经济学是经济学研究的基本方法论，是经济学实证研究的技术分析工具。
本教材定位于初、中级计量经济学的难度和内容，面向财经类专业的本科生、自修者以及从事经济量化研究的人士，力求使读者在三个方面得以入门和提高：①掌握计量经济学的基本原理，解决实际经济计量问题的基本思想和方法；②熟练使用EViews计量经济学专用软件，掌握解决实际经济计量问题的工具；③把握计量经济学前沿理论和技术的进展。
另外，本教材强调经济计量理论和经济计量软件的学习相辅相成，理论学习为软件学习的基础，软件学习是理论学习的目的。
本教材的基本框架由四部分构成：①线性回归模型。
本部分以对线性回归模型的基本假定为核心，介绍线性回归模型的设定、估计、检验和应用，并围绕违背统计基本假定的问题探讨多重共线、异方差、自相关和随机解释变量问题。
②线性回归模型的扩展。
本部分将回归模型的数学形式由线性扩展到非线性；将解释变量由经济变量扩展到定性变量；将单一回归模型扩展到联立方程模型；将静态模型扩展到动态模型；将模型估计方法由OLS法扩展到极大似然法、NLS法、RLS法、IV法、GLS法、ILS法、2SLS法和3SLS法等。
并介绍了模型稳定性检验、Granger因果关系检验，等等。
同时介绍了二分变量的Probit、Logit模型，随机时间序列的ECM模型、ARMA模型等前沿性的计量经济学理论和技术。
③主要经济计量模型的应用。
如生产函数模型、成本函数模型、需求函数模型、消费函数模型、投资函数模型等。
④EViews软件的应用。
本教材的特点是：①每章在系统地介绍基本理论的基础上，运用EViews软件处理实际统计资料进行经济计量分析和建模示范；②每章后附有小结及思考与练习题，便于对主要内容及时把握和巩固；③尽量给出经济计量理论中有关结论的数学推导和证明，便于读者理解；④介绍了EViews软件的基本操作和功能，目的是降低读者学习计量经济学的难度，增加学习兴趣并有效地掌握软件的操作运用，提高动手能力。

<<计量经济学>>

书籍目录

第1章 计量经济学的基本问题1.1 什么是计量经济学1.2 计量经济学分科1.3 计量经济学方法论1.4 经济计量模型的类型和构成1.5 建模数据的收集与加工1.6 经济计量模型的应用1.7 经济计量应用软件简介第2章 简单线性回归模型2.1 相关和回归的关系2.2 一元线性回归模型2.3 过原点的一元线性回归2.4 二元线性回归模型2.5 EViews应用第3章 K元线性回归模型3.1 回归模型的设定3.2 回归模型的参数估计3.3 拟合优度测量3.4 参数假设检验3.5 预测应用3.6 偏相关系数和复相关系数3.7 评价回归模型3.8 EViews应用第4章 K元线性回归模型的扩展4.1 解释变量设定偏误及其检验4.2 虚拟变量（Dumb Variable）模型4.3 模型估计方法4.4 统计检验第5章 多重共线性5.1 多重共线性的含义5.2 多重共线性的来源和后果5.3 多重共线性的诊断5.4 多重共线性的补救措施5.5 EViews应用5.6 多重共线性一定要处理吗第6章 异方差6.1 广义最小二乘法原理6.2 异方差的来源及后果6.3 异方差的检验6.4 异方差的处理6.5 EViews应用第7章 自相关7.1 自相关的含义及类型7.2 自相关的来源及后果7.3 自相关的检验7.4 模型的估计和预测7.5 EViews应用第8章 随机解释变量8.1 统计量的渐近性质8.2 随机解释变量问题8.3 工具变量法8.4 EViews应用第9章 滞后变量模型9.1 滞后效应9.2 滞后变量模型的类型9.3 分布滞后模型的估计9.4 自回归模型的建立9.5 自回归模型的估计9.6 EViews应用9.7 格兰杰因果关系检验第10章 随机时间序列分析10.1 平稳性的概念10.2 单整的单位根检验10.3 协整（Unit Root Test）和协整检验10.4 误差修正模型10.5 平稳时间序列模型第11章 联立方程模型11.1 联立方程模型的基本概念11.2 联立方程模型的类型11.3 递归系统模型11.4 模型识别（Identification）的概念11.5 识别条件11.6 联立方程模型的估计方法11.7 联立方程计量经济模型的检验11.8 EViews应用第12章 经济计量模型的应用+12.1 单方程模型的应用12.2 宏观经济计量模型——方程组模型的应用第13章 EViews经济计量软件包基础13.1 EViews软件包的基本功能13.2 EViews软件包的主要功能菜单13.3 EViews软件的常用命令13.4 文件操作命令附录附录1A 矩阵代数预备知识附录2A 统计预备知识附录3A 参数线性约束F检验附表附表1 标准正态分布表附表2 t分布临界值表附表3 x2分布临界值表附表4 F分布临界值表附表5 D.w.检验上下界表附表6 1%和5%临界（A）DF检验t（=tT）统计量和F统计量附表7 协整检验EG或AEG的临界值参考文献

章节摘录

第1章 计量经济学的基本问题　　1.2 计量经济学分科　　根据研究内容的不同，计量经济学可划分为理论计量经济学和应用计量经济学。
根据研究特征的差异，计量经济学可划分为经典计量经济学和非经典计量经济学。
1.2.1 理论计量经济学和应用计量经济学　　理论计量经济学探讨对经济计量模型设定的经济关系式的测度方法。
如对于本书中广泛使用的最小二乘法（Least Squares），理论计量经济学探讨此方法所涉及的假定、方法的性质以及某些假定不成立时，对这些性质的影响。
应用计量经济学则以理论计量经济学作为工具，去研究经济领域中的问题，如生产函数、投资函数、供求函数等，侧重于建立与应用模型进行实际问题的处理。
本书对理论计量经济学和应用计量经济学均有涉及。
1.2.2 经典计量经济学和非经典计量经济学　　经典计量经济学一般指20世纪70年代以前发展并广泛应用的计量经济学，它们具有显著的共同特征：①模型类型：采用随机模型；②模型导向：以经济理论为导向建立模型；③模型结构：变量之间的关系表现为线性或者可以化为线性，属于因果分析模型，解释变量具有同等地位，模型具有明确的形式和参数；④数据类型：以时间序列数据或者截面数据为样本，被解释变量为服从正态分布的连续随机变量；⑤估计方法：仅利用样本信息，采用最小二乘法或者极大似然法估计变量。
非经典计量经济学一般指20世纪70年代以后发展的以微观计量经济学、非参数计量经济学和动态计量经济学为主要内容的计量经济学理论、方法及应用模型，也称现代计量经济学。

第一图书网, tushu007.com

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