

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787543214446

10位ISBN编号：754321444X

出版时间：2009-8-1

出版时间：格致出版社

作者：（美）斯托克,（美）沃森

页数：600

字数：631000

译者：孙燕

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&gt;&gt;

## 前言

计量经济学能成为一门使老师和学生都觉得有趣的课程。  
有关经济、企业和政府的现实世界是一个复杂混乱的地方，充满了需要回答的冲突和问题。  
例如，是通过颁布严厉的法律还是增加酒类税收对付酒后驾车更有效？  
你在股票市场上是买入价格相对收入较低的股票，还是遵照股票价格随机游走理论建议的不采取任何行动而只是观望，哪一个能赚钱呢？  
我们是通过减小班级规模，还是只是让我们的孩子每天听十分钟莫扎特音乐来提高小学教育呢？  
计量经济学帮助我们我们从疯狂的思想中挑选出合理的思想，找出重要定量问题的定量答案。  
她为我们打开了一扇窗，让我们看到了复杂世界里的人、企业和政府作决策时依据的因素之间的关系。

本教材是专为本科计量经济学设计的入门课程。  
我们的经验是要在初级课程中注重计量经济学理论与应用的关联性，即感兴趣的应用必定会推动理论，而理论必须与应用相匹配。  
这一简单原理是本教材和老一代计量经济学课本的重大区别，老的课本中的理论模型和假设与应用不匹配。  
造成某些学生在花费大量时间学习假设后发现这些假设是不现实的，于是他们必须学习与应用不符的这些假设导致的“问题”的“解决方法”，无怪乎他们会对计量经济学的关联性感到疑惑。  
我们认为最好从具体应用出发引入所需的方法，然后给出与该应用相匹配的一些假设。  
由于理论与应用直接对应，因此该处理方法使计量经济学变得栩栩如生。

## <<计量经济学>>

### 内容概要

《计量经济学》（第二版）属于本科层面的融理论与实践于一体的优秀教科书，也可作为研究生层次的入门教材，国外院校普遍采用此书。

本书充分利用实证分析的现实问题与数据，通过简洁明晰的处理方式架起统计方法与经济解释之间的桥梁，明确突出计量经济学的实用方法，帮助学生全面理解计量经济学的基本内容，不仅包括回归分析、最小二乘法、异方差、序列相关、工具变量等传统内容，还涉及弱工具变量、项目评估、面板数据方法、时间序列分析等最新计量经济学的研究成果。

《计量经济学》（第二版）继承第一版的传统，继续采用普通的、完全可操作的、现实世界的实证分析事例说明计量经济学的方法与理论，这些“有趣”的事例包括教育经济学、住宅贷款市场的种族歧视、香烟需求与宏观经济预测等。

## <<计量经济学>>

### 作者简介

詹姆斯·H.斯托克，加州大学伯克利分校经济学博士，曾任教于加州大学伯克利分校及哈佛大学肯尼迪政府学院。

研究领域为经济计算方法、宏观经济预测、货币政策等，曾发表论文90项多篇，并出版若干其他专著。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

前言第一篇 导论与复习 1 经济问题和数据 1.1 我们研究的经济问题 1.2 因果效应和理想化试验 1.3 数据：来源和类型 本章小结 重要术语 内容复习 2 概率论复习 2.1 随机变量和概率分布 2.2 期望值、均值和方差 2.3 二维随机变量 2.4 正态分布、卡方分布、学生t分布和F分布 2.5 随机抽样和样本均值的分布 2.6 抽样分布的大样本近似 本章小结 重要术语 内容复习 习题 附录2.1 重要概念2.3中结论的推导 3 统计学复习 3.1 总体均值的估计 3.2 有关总体均值的假设检验 3.3 总体均值的置信区间 3.4 不同总体的均值比较 3.5 基于试验数据的因果效应的均值之差估计 3.6 样本容量较小时使用t统计量 3.7 散点图、样本协方差和样本相关系数 本章小结 重要术语 内容复习 习题 实证练习 附录3.1 美国当前人口调查 附录3.2  $y$ 是 $\mu_y$ 的最小二乘估计量的两种证明方法 附录3.3 样本方差一致性的证明第二篇 回归分析基础 4 一元线性回归 4.1 线性回归模型 4.2 线性回归模型的系数估计 4.3 拟合优度 4.4 最小二乘假设 4.5 OLS估计量的抽样分布 4.6 结论 本章小结 重要术语 内容复习 习题 实证练习 附录4.1 加利福尼亚测试成绩数据集 附录4.2 OLS估计量的推导 ..... 5 一元线性回归：假设检验和置信区间 6 多元线性回归 7 多元回归中的假设检验和置信区间 8 非线性回归函数 9 基于多元回归的评估研究第三篇 回归分析与深入专题 10 面板数据回归 11 二元因变量回归 12 工具变量回归 13 试验和准试验第四篇 经济时间序列数据的回归分析 14 时间序列回归和预测导论 15 动态因果效应的估计 16 时间序列回归的其他专题第五篇 回归分析的计量经济学理论 17 一元线性回归理论 18 多元回归理论附录参考文献部分答案术语表

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

小学教育有各种各样的目的，如培养社交能力，但对大多数家长和教育家们而言，其最重要的目的是阅读、写作和初等数学的基础学科学习。

一项关于改善这些基础学习最突出的提议是缩小小学的班级规模。

理由是班级的学生人数越少，则每个学生就能得到老师越多的关注，学习进度也就加快了，学生的学习效率也就提高了，成绩也就进步了。

但是，缩小班级规模对小学教育的影响到底有多大？

缩小班级规模需要费用，如需要雇用更多的教师，如果学校可用教室早已达到饱和，那么需要新建更多的教室。

决策者必须权衡成本和收益。

因此决策者必须对可能的收益有精确的定量的了解。

缩小班级规模对小班基础教育的有利影响有多大？

是否存在这样一种可能性，即缩小班级规模实际上对初等教育并无影响？

虽然常识和日常经验或许告诉我们学生人数越少时学生能学到的知识会更多，但常识无法精确地告诉我们缩小班级规模究竟对初等教育有多大的影响？

为了回答这个问题，我们必须研究有关班级规模和初等教育之间的经验证据，即基于数据的证据。

我们在本书中利用了1998年从加利福尼亚420个学区收集到的数据，来研究班级人数和基础学习之间的关系。

在该数据中，小班规模的学区相比大班规模的学区而言，其学生在标准化测试中的表现往往更好些。

虽然这个事实和班级规模越小成绩越好的观点相吻合，但这也许只是反映了小班学区的学生在其他方面比大班学区的学生有更多的优势。

例如，小班学区的居民往往比大班学区的居民更富有，因此小班学区的学生比大班学区的学生有更多的课外学习机会。

可能正是由于这种额外的学习机会而不是较小的班级规模使得他们能取得较好的成绩。

在第二篇中，我们将利用多元回归分析分离出班级规模变化和其他一些因素如学生的经济状况等对学习成绩的影响。

1.1.2 问题2：住房贷款市场中存在种族歧视吗？

大多数老百姓通过抵押（即由住房价值作抵押担保的一大笔贷款）购买住房。

按相关法律规定，美国的主要机构不能出于种族因素决定同意还是拒绝购房者抵押贷款申请，即如果两个申请者除了种族不同外其他方面都相同，则他们的抵押贷款申请被批准的可能性也应该相同。

那么从理论上讲，在抵押贷款中不存在种族歧视。

与这个理论结论相反的是，波士顿联邦储备银行的研究员们发现（基于1990年初以来的数据），在申请抵押贷款时，黑人申请者中有28%的人被拒，而白人中只有9%的人被拒。

这些数据是否表明事实上在抵押贷款中存在种族歧视？

如果存在，这种歧视有多严重？

## <<计量经济学>>

### 媒体关注与评论

《计量经济学》(第二版)中介绍的各种推动经济计量方法发展的简单事例十分吸引学生。

——Elena Pesavento, 艾莫雷大学 我喜爱讨论当前的各种政策问题和计量技术的实证分析方面的应用事例。

对于讲授强调计量经济学应用课程的本人而言, 斯托克和沃森的《计量经济学》(第二版)是一本适合学生与教师需求的好教材。

——Carolyn J. Heinrich, 威斯康星大学麦迪逊分校 书中的“内容复习”与“习题”部分所提供的问题非常出色。

这些问题的难易程度搭配合理, 它们不仅能很好地联系各章的内容, 还有利于培养学生考虑适当的实证分析问题与细节的能力。

——Charles S. Wassell, Jr. 华盛顿中央大学

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>