

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787810789950

10位ISBN编号：7810789953

出版时间：1970-1

出版时间：对外经济贸易大学

作者：于俊年

页数：486

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;

## 内容概要

《普通高等教育“十一五”国家级规划教材：计量经济学（第2版）》分四篇共十六章。第一篇导论，第二篇单方程回归模型的基本理论和方法，第三篇违背经典回归假定的有关经济计量模型，第四篇经济模型构造理论与应用。

本教材由浅入深，循序渐进，理论与应用并重将理论计量经济学和应用计量经济学融为一体，每章首配有本章要点，每章尾配有小结和复习思考题，便于读者使用。

为读者学习计量经济学提供了一本切合的教材。

本版与第一版的不同之处在于：增加了对于当代计量经济学新发展的介绍，如向量自回归模型（VAR）、因果关系检验，条件异方差（ARCH）模型等，并在每章末尾增加了如何应用EViews软件来估计模型的参数。

《普通高等教育“十一五”国家级规划教材：计量经济学（第2版）》是高等院校经管类专业本科、研究生的首选教材，亦可作为广大经济、管理人士学习计量经济学的最佳参考读物

<<计量经济学>>

作者简介

于俊年，1964年毕业于北京科技大学（原北京钢铁学院）。  
现任对外经济贸易大学教授，研究领域包括计量经济学、项目经济分析数量方法、线形规划、项目评估与可行性研究，出版并发表多本著作和学术论文。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一篇 导论第一章 计量经济学概述 § 1.1 什么是计量经济学 § 1.2 计量经济学的研究对象、内容与步骤 § 1.3 小结第二篇 单方程线性回归模型第二章 一元线性回归分析 § 2.1 一元线性回归模型及基本假定 § 2.2 回归参数的最小二乘估计 § 2.3 参数最小二乘估计量的统计性质 § 2.4 参数估计量的抽样分布及估计量的估计 § 2.5 回归参数的f检验和区间估计 § 2.6 回归方程的显著性检验和拟合优度 § 2.7 无条件预测 § 2.8 案例分析：一元回归模型计算举例（1） § 2.9 案例分析：一元回归模型计算举例（2） § 2.10 有条件预测 § 2.11 小结第三章 多元线性回归分析 § 3.1 多元线性回归模型及其基本假定 § 3.2 多元线性回归模型参数的最小二乘估计 § 3.3 参数估计量的统计性质 § 3.4  $O_u/2$ 的估计量和拟合优度R § 3.5 回归参数的显著性检验和置信区间 § 3.6 多元线性回归模型的F检验 § 3.7 预测 § 3.8 案例分析：多元线性回归分析 § 3.9 极大似然估计法 § 3.10 参数带约束条件的最小二乘估计 § 3.11 小结第四章 相关分析 § 4.1 相关的概念 § 4.2 偏相关系数 § 4.3 复相关系数 § 4.4 小结第三篇 违背经典回归假定的单方程计量模型第五章 异方差 § 5.1 异方差性 § 5.2 异方差性的后果 § 5.3 异方差性的检验方法 § 5.4 异方差性问题的解决方法 § 5.5 小结第六章 自相关 § 6.1 自相关.....第四篇 计量经济模型构造理论与应用

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

20世纪60年代弗兰克·莫迪里亚尼(Franco Modigliani)、默顿·H·米勒(Morton H. Miller)、哈里·M·马科维茨(Harry M. Markowitz)、威廉·F·夏普(William F. Sharpe), 将计量经济学方法应用于证券与投资研究, 开创了金融计量经济学应用的新领域。

20世纪70年代以来, 计量经济学的理论和应用又进入一个新阶段。

一方面由于计算机的广泛应用和新的计算方法大量出现, 使所用的计量经济模型和变量的数目越来越多, 另一方面表现为宏观计量经济模型的研制和应用方面。

目前已有一百多个国家编制了不同的宏观计量经济模型, 模型也由地区模型逐步发展到国家模型乃至世界模型。

宏观计量经济模型的发展趋势: 一是模型的规模越来越大(例如克莱因发起的世界连接模型, 包括7000多个方程、3000多个外生变量), 二是模型体系日趋完善, 涉及生产、需求、价格及收入等经济生活的各个领域。

与此同时, 近十几年计量经济学的理论方法又有新的突破, 例如协整理论的提出, 使计量经济学产生了新的理论体系; 模型识别理论、参数估计方法也有了重大发展; 对策论、贝叶斯方法等理论在计量经济学中的应用已成为计量经济学新的增长点。

总之, 计量经济学是一门在经济科学中占有重要地位, 正在不断发展的综合性边缘学科。

计量经济学在一定程度上反映了社会大生产对各种经济因素和经济活动进行数量分析的客观要求。

经济学从定性研究向定量分析的发展, 是经济学向更加精确更加科学的方向发展的表现。

正如马克思指出: 一种科学只有在成功地运用了数学以后, 才算达到了完善的地步。

计量经济学中的各种方法和技术, 多数是从数学或统计学中来的, 这些方法和技术完全可以在研究中国经济问题时借鉴, 一定能够在中国的经济理论研究和现代化经济建设中发挥重要作用。

中国计量经济学真正快速发展是在改革开放以后。

1979年成立了中国数量经济研究会和数量经济研究所, 并出版了会刊《数量经济技术经济研究》。

1982年召开第一届数量经济学会, 从此计量经济方法得到了广泛应用。

20世纪80年代中期中国社会科学院开始建立“中国宏观经济年度预测模型”, “世界连接计划”中国模型等。

1992年开始, 我国每年春秋两季对中国宏观经济进行分析和预测, 并于同年11月出版了《中国经济蓝皮书》。

1998年7月教育部高等学校经济学学科教学指导委员会决定将“计量经济学”列为高等学校经济学门类各专业的八门核心课程之一(八门核心课包括政治经济学、西方经济学、计量经济学、货币银行学、财政学、统计学、会计学、国际经济学)。

将计量经济学列入经济学各专业核心课, 是我国经济学学科教学走向现代化和科学化的重要标志, 对提高我国经济学人才培养质量和研究水平具有重要意义。

.....

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>