

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787811343038

10位ISBN编号：7811343037

出版时间：2009-3

出版时间：北京对外经济贸易大学出版社有限责任公司

作者：于俊年

页数：295

字数：386000

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

奉献在读者面前的这套教材，由对外经济贸易大学国际经济贸易学院教师根据多年的教学科研经验精心编写，从我国加入世界贸易组织五年过渡期结束后的2007年初开始陆续出版，是一项重要的教材建设工程。

它与我国改革开放的新时代同步发展，标志着我院为国家培养创新型高等人才所作出的一份特殊贡献。

我院历来重视教材建设，秉承50多年学科建设的经验积累，在国际经济与贸易、金融、国际运输与物流、经济学等专业领域先后出版了大量教材，在全国产生了较大的影响。

如《国际贸易实务》、《国际贸易》等累计发行近150万册，先后被评为国家级精品课程。

本系列教材的出版，是对我院近十年来学科建设成果的一次检阅。

自“九五”以来，以“211工程”建设为契机，我院对本科和研究生教育进行了认真全面的专业梳理和课程体系优化，以面向新世纪、面向全球化、面向提升学生职业生涯竞争力为导向，在课程建设和教材建设方面视野开阔、目标明确、标准严格、工作扎实，老中青三代学者共同努力，基本完成了学院所开设专业课程的教材和教学辅助资料的编写工作。

回顾我院“九五”以来课程体系建设，我们走过了一条清晰的发展之路。

首先是课程群的界定和建设，我们抓住20世纪90年代中期我国全面推进改革开放所带来的对外向型经济人才的需求急速增加的机遇，围绕着我院长期积累的在国际经济与贸易、国际金融、国际运输与物流等专业所形成的专业优势，借鉴国际上高水平大学的课程建设经验，设定了培养学生具有国际竞争力所需要的课程群。

在此基础上狠抓师资队伍建设和，通过海内外招聘和支持现有教师在国内攻读博士学位，以国际化的标准打造了一支高水平的师资队伍，凝聚了学科建设的核心力量。

然后以国际高水平大学的科研和教学标准评价师资队伍，以高水平科研促进高水平教学，实现科研与教学的相互促进。

随着学科建设的不断进步，我院的专业领域和课程覆盖面均有了很大的突破。

## <<计量经济学>>

### 内容概要

本教材是作者在2007年11月出版的《计量经济学(第二版)》的基础上压缩精炼而成的，仍然保持了第二版的内容体系，由浅入深，循序渐进，理论与应用并重，将理论计量经济学与应用计量经济学融为一体。

全书分为三篇，共十一章。

第一篇导论，第二篇系统地讲述单方程线性回归模型的基本理论和方法，第三篇系统地讲述违背经典回归假定的有关经济计量模型。

每章之首配有本章要点，每章末尾配有小结和复习思考题，便于读者使用。

本书的出版，为读者学习计量经济学提供了一本快速入门的好教材。

本教材可作为高等院校经济、管理类专业本科教材，也可作为研究生和广大经济、管理工作者的学习计量经济学的参考读物。

<<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  $2u$  的估计量§ 2.5 回归参数的  $t$  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 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 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 回归参数估计量的统计性质

§ 3.4  $2u$  的估计量和拟合优度  $R^2$ § 3.5 回归参数的  $F$  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 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

## § 6.2 自相关对参数估计量的影响

## § 6.3 检验自相关的方法

## § 6.4 消除自相关影响的方法

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

§ 6.5 关于存在自相关时的预测的说明

§ 6.6 小结

## 第七章 多重共线性

§ 7.1 多重共线性的概念

§ 7.2 多重共线性的后果

§ 7.3 多重共线性的检验

§ 7.4 消除多重共线性的方法

§ 7.5 小结

## 第八章 虚拟变量模型

§ 8.1 虚拟变量与线性模型

§ 8.2 非线性概率模型

§ 8.3 小结

## 第九章 联立方程模型

§ 9.1 联立方程模型的概念

§ 9.2 偏倚性和不一致性的产生

§ 9.3 联立方程模型的类型

§ 9.4 同时方程模型的识别问题

§ 9.5 结构方程的识别规则

§ 9.6 联立方程模型的参数估计方法概述

§ 9.7 间接最小二乘法(ILS法)

§ 9.8 工具变量法(IV法)

§ 9.9 二阶段最小二乘法(2SLS法)

§ 9.10 小结

## 第十章 平稳时间序列分析

§ 10.1 时间序列的基本概念

§ 10.2 自回归过程AR(p)

§ 10.3 移动平均过程MA(g)

§ 10.4 自回归移动平均模型ARMA(p, g)

§ 10.5 小结

## 第十一章 非平稳时间序列分析

§ 11.1 非平稳时间序列基本概念

§ 11.2 时间序列的平稳性检验

§ 11.3 协整理论简介

§ 11.4 小结

## 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  $\chi^2$ 分布临界值表

附表4 F分布临界值表

附表5 杜宾-沃森检验上下界表

## 参考书目

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

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 一、计量经济学的含义 计量经济学作为一门独立的学科产生于20世纪30年代。经过七十多年的发展，今天的计量经济学已经成为经济学的一个重要分支，其实用价值也正在越来越广泛的范围内表现出来。

“Econometrics”一词最早是由挪威经济学家、第一届诺贝尔经济学奖获得者拉格纳·费瑞希（Ragnar Frisch）仿照Biometrics（生物计量学）一词提出的。中文译名有两种：一种由英文直译为经济计量学，而且强调该学科的主要内容是经济计量的方法；另一种译为计量经济学，即通过名称强调它是一门经济学科。

1930年12月29日费瑞希（R.Frisch）、荷兰经济学家丁伯根（J.Tinbergen）等和一些国家的经济学家在美国成立了“国际计量经济学会”，该学会于1933年创办了《计量经济学》（Econometrica）杂志。

在这个杂志的创刊号上费瑞希对什么是计量经济学作了一个较详细的描述：“对经济的数量研究有几个方面，其中任何一个就其本身来说都不应和计量经济学混为一谈。

既不能认为计量经济学就是经济统计学；也不能把计量经济学和所谓的一般经济理论等同起来，尽管经济理论大部分具有确定的数量特征；计量经济学也不应看作数学应用于经济的同义语。

经验证明，要真正了解现代经济生活中的数量关系，统计学、经济理论和数学三个方面观点的每一种都是必要的，然而单独一方面的观点则又是不充分的。

这三方面观点的结合才是强有力的，正是这种结合才构成了计量经济学。

”  
.....

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>