第一图书网, tushu007.com

<<计量经济学基础（第四版）（>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学基础（第四版）（上、下册）>>

13位ISBN编号：9787300036281

10位ISBN编号：7300036287

出版时间：2005-4

出版时间：人民大学

作者：美古扎拉蒂

页数：977

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

写作的背景和宗旨写作《计量经济学》第四版的主要目的和前三版一样，是用不超过初等水平的矩阵代数、微积分或统计学，对计量经济学做一个初等而又全面的介 绍。
在本版中，我力图把1995年第三版问世以来计量经济学理论和实践中 所出现的某些进展包括进来。
有了高级而又被使用者所钟爱的统计软件，如 Eviews，Limdep，Microfit，Minitab，PcGive，SAS，Shazam和Stata等，现 在就能对本书前三版尚不能包括的几个计量方法展开讨论。
我在本版的一些 例子和习题中充分利用了这些统计软件。
我很愉悦而又吃惊地发现，不仅经济学和商学院的学生在使用我的书，而且政治学、国际关系学、农业学和健康科学等其他学科的学生也在用我这 本书。
这些学科的学生会发现，本书对几个专题所展开的讨论是很有用的。
第四版 本版的主要蛮化如下．1．在引言一章中，在讨论过传统计量方法论的步骤之后，我将讨论如何从几个不相上下的计量模型中选择一个合适模型的问题，这是一个很重要 的问题。
XXVl"2．在第1章中，我很简要地讨论了经济变量的度量尺度。
其重要性在于，知道变量是比率尺度、区间尺度、序数尺度还是名义尺度，就能决定在给定情形中用哪种计量方法比较适当。
3．第3章的附录包含有OLSlSt-{．量的大样本性质，特别是一致性。
4．第5章的附录引入了本书中广泛使用的四个重要概率分布(即正态 分布、￡分布、；[。
分布和F分布)的性质及其相互关系。
5．在关于回归模型函数形式的第6章中，现在包含有对标准化变量回归的讨论。
6．为了让非专家能更容易理解，我将对线性回归的矩阵表述方法从原来的第9章移到附录C。
并将附录C略加扩充，以包括某些较喜欢数学的学 生感兴趣的高深内容。
新的第9章就讨论虚拟变量回归模型。
7．关于多重共线性的第10章，包含有对著名的朗利(Longley)数据的广泛讨论，朗利数据非常有助于阐明多重共线性的性质和范围。
8．关于异方差性的第1l章，现在在附录中包含有对怀特(whit。
)稳健标准误的直观讨论。
9．关于自相关的第12章，现在包含有对纠正OLS标准误的尼威一怀斯特(Newey"一West)方法，以考虑误差项中可能出现自相关的问题。
纠正后的标准误被称为}tA(：标准误。
本章还将简要地讨论含有自相关误差项的预测这一专题。
10．关于计量建模的第13章，取代了原来的第13、14章。
应用研究者将发现，本章包含有一些特别有用的新专题。
这些专题包括对模型选择准则 的简明讨论，如赤池信息准则(Akaiker information criterion)、施瓦茨信息准 则(Schwarz information criterion)、马娄斯的Cp(Mallows"s Cpcriterion)准则和预测x2(forecast chi squre)准则。
本章还讨论诸如异常数据(outliers)、 杠杆数据(1ever"age)、有影响力数据(influennce)、递归最小二乘法(recklrsive least squares)和邹至庄的预测失灵检验(Chow"s prediction failure test) 等专题。
本章结束时，对从事计量理论和计量实践的专家提出了警戒性的忠告。
11．关于非线性回归模型的第14章是全新的。
由于可轻松自如地使用统计软件，所以估计非线性于参数的回归模型就不再困难。
有些计量模型天 生就不是参数的线性函数，并需要用迭代方法来估计。
本章讨论并解释某些估计非线性参数回归模型的相对简单的方法。
12．关于定性响应回归模型的第15章取代了原书关于虚拟因变量回归 模型的第16章，对涉及具有定性性质因变量的回归模型展开了广泛的讨论。
主要集中讨论logit和probit，模型及其变异模型。
本章还讨论了用于对计数数据(如一个企业一年内得到的专利数，5分钟内接听的电话数等)建模的泊松

回归模型(Poisson regression model)。
本章也对多项式logit和probit模型及持续期间模型进行简单讨论。
13．关于综列数据回归模型的第16章也是新的一章。
综列数据兼具时间序列和横截面数据的特点。
由于在社会科学中可以利用的综列数据越来越 多，所以综列数据回归模型也被许多领域的研究者越来越多地采用。
针对估计基于综列数据的回归模型时通常使用的固定效应(fixed effects)模型和随 机效应(random effects)模型，本章进行了非技术性的讨论。
14．关于动态计量模型的第17章，现在包含有对格兰杰(Granger)因果性检验相当广泛的讨论，在应用研究中都会例行使用到(或误用到)这个检验。
格兰杰因果性检验对模型中所用到的滞后项的个数是很敏感的。
还要假定模型背后的时间序列是平稳的。
15．除了增加一些新的解答题和对现有估计方法略微引申之外，关于联立方程模型的第18、19和20章基本上没有变化。
这些都反映了如下事实 由于一系列原因，包括它们在20世纪70年代0PEC石油冲击预测中的不良 表现，人们对这种模型的兴趣逐渐淡漠。
16．第21章对原21章进行了重大修订。
在这一章中，提出并说明了时间序列计量经济学中的几个概念。
本章的要点是平稳时间序列的性质和重要性。
本章给出了几种查明某给定时间序列是否平稳的方法。
一个时间序列的 平稳性，对应用本书中所讨论的各种计量方法而言至关重要。
17．第22章也对原22章进行了明显的修订。
它讨论了基于博克斯一詹金斯(Box-Jenkins)(ARIMA)和向量自回归(vectol autoregression，VAR) 方法论而进行的经济预测专题，还讨论了用条件异方差自回归(autoregression siVe conditional heteroscedasticity，ARCH)和广义条件异方差自回归(generalized alJtoregtessive!conditional heteroscedasticity，GARCH)方法度量金融时间 序列中的易变性这个专题。
18．关于统计概念的附录A略加丰富。
附录C利用矩阵代数讨论了线性回归模型。
这些有益于更高年级的学生。
和前面的版本一样，本书所讨论的所有计量方法都由例子加以说明，其 中有些例子是基于各个学科坚实的数据基础。
章末的问答题和解答题增加了一些新的例子和数据集。
对于更高层次的读者，每章都有一些技术性的附 录，给出书中提出的各个定理和／或公式的证明。
课程安排和内容选择此版的变化大大地扩展了本书的论述范围。
我希望教师因此在选择适合其听众的专题方面，有充分的灵活性。
这里给出如何使用本书的一些建议。
非专业人员一学期的课程：附录A、第19章及对第10～12章做一浏览 (略去全部证明)。
经济学专业一学期的课程：附录A和第1～13章。
经济学专业两学期的课程：附录A、B、C和第1～22章。
第14和16章可以有选择性地学习。
某些技术性的附录可以不讲。
毕业生、研究生和研究者：将本书作为计量经济学主题方面必备的参考书。
配套材料"数据CD每本书都配有一张含有文中数据的CD，CD是ASCII或文本格式的，用绝大多数软件包都能读。
《学生习题解答手册》对教师免费、对学生出售的《学生习题解答手册》(ISBN:00"7242"7922)，包含了书中475道问答题和解答题的答案。
EViews我们很高兴本书的第四版在一张CD上与书中所有数据一起提供EViews的学生版3．1。

这个软件和教材(ISBN：00"72565"705)一起可以从出版商那 里获得。
EViews学生版也可以单独从QMS获得。
详细信息在如下网址查阅：http：／／www．eviews．corn。
网址 有一个综合性的网址提供了支持计量经济学学习所需要的辅助材料：www．mhhe．com／eccmorner rics／gujarati4。

内容概要

该书十分重视基础知识的教学及训练，内容深入浅出。
该书的特点之一是：充分考虑了学科发展的前沿，使微观计量经济学的定性与限值应变量方法和宏观计量经济学的时间序列分析都占有相当篇幅。
同时，《计量经济学基础（第4版）（套装上下册）》突出强调了计量经济学对经济和金融数据的应用分析。
第四版新改进之处：（1）“线性回归的矩阵表述”部分有所压缩；（2）有关“计睛经济建模”的章节有所精简；（3）新增了“非线性回归模型”一章。
（4）新增了一些“综例数据回归模型”的方面的材料。

作者简介

达摩达尔·N·古扎拉蒂在执教于纽约市立大学28年多之后，现在是纽约州西卢美国军事学院社会科学系的经济学教授。
古扎拉蒂博士于1960年获孟买大学工商学硕士学位，1963年获芝加哥大学工商行政硕士学位，并于1965年获芝加哥大学博士学位。
古扎拉蒂博士曾在知名的国内和国际期刊诸如Reviow of Economics and Statistics, Economic Joumal, Journal of Mnancial and Quantitative Analysis, Journal of Business, American Statistician 和 Journal of Industrial and Labor Relations发表论文多篇。
古扎拉蒂博士现任多种期刊和图书出版社的编辑评判人，并且是印度官方刊物 Journ of Quantitative Economics的编委会成员。
古扎拉蒂博士曾是英国Sheffield大学访问教授（1970-1971年），是访问印度的Fulbrigth教授（1981-1982年），新加坡国立大学管理学院访问教授（1985-1986年）以及澳大利亚New South Wales大学计量经济学教授（1988年夏）。
作为美国新闻署赴少外讲学的一们参与者，古扎拉蒂博士曾在澳大利亚、孟加拉国、德国、印度、以色列、毛里求斯、韩国等广泛讲授微观和宏观经济学专题。
古扎拉蒂博士还在加拿大和墨西哥举办过学术研究会并讲演。

书籍目录

引 言……1第1篇 单一方程回归模型……1 第1章 回归分析的性质……3 第2章双变量回归分析：一些基本概念……24 第3章双变量回归模型：估计问题……45 第4章经典正态线性回归模型……90 第5章双变量回归：区间估计与假设检验……101 第6章双变量线性回归模型的延伸 ……145 第7章多元回归分析：估计问题……183 第8章多元回归分析：推断问题……229 第9章虚拟变量回归模型……274第2篇放松经典模型的假定……313 第10章多重共线性：回归元相关会怎么样?……318 第11章异方差性：误差方差不是常数会怎么样? ……364 第12章 自相关：误差项相关会怎么样?……416 第13章计量经济建模：模型设定和诊断检验……475第3篇计量经济学专题……525 第14章非线性回归模型……527 第15章定性响应回归模型……543 第16章综列数据回归模型……599 第17章动态计量经济模型：自回归与分布滞后模型……619第4篇联立方程模型……675 第18章联立方程模型……677 第19章识别问题……695 第20章联立方程方法……719 第21章时间序列计量经济学：一些基本概念……748 第22章时间序列计量经济学：预测……788 附录A统计学中的若干概念复习……820 附录B矩阵代数初步……860 附录C线性回归模型的矩阵方法……875 附录D统计学用表……907 附录E互联网上的经济数据……925参考文献……928人名索引……933标题索引……941译后记……977

编辑推荐

《计量经济学基础(上下)》(第4版)的特点之一是：充分考虑了学科发展的前沿，使微观计量经济学的定性与限值应变量方法和宏观计量经济学的时间序列分析都占有相当篇幅。
同时，突出强调了计量经济学对经济和金融数据的应用分析。

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