

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787300045030

10位ISBN编号：7300045030

出版时间：2002年01月

出版时间：中国人民大学出版社

作者：潘省初

页数：197

字数：236000

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

本书是在作者为中央财经大学本科生讲授“计量经济学”所使用讲稿的基础上修订而成的。从20世纪80年代末期开设“计量经济学”课程，至今已有十多年。

在此期间，随着本学科不断发展，使用的讲稿经过多次修改，目标是：(1)使教学内容跟上计量经济学的最新发展，能够反映本领域科研和教学的最新成果；(2)尽量使教学内容适合于财经类专业学生学习计量经济学，使学生能更好地理解 and 领会计量经济学理论和方法的本质，并能学以致用。

经过多年的教学实践，可以说，在这两个方面都取得了令人满意的进展。

? 全书共分八章。

第一章，绪论；第二章，计量经济学的统计学基础；第三章，〔HK〕双变量线性回归模型；第四章，多元线性回归模型；第五章，模型的建立与估计中的问题及对策；第六章，动态经济模型：自回归模型和分布滞后模型；第七章，时间序列分析；第八章，联立方程模型。

? 第一章是全书的概论，在介绍什么是计量经济学及其产生和发展的过程之后，用一个简单的例子展示了计量经济学方法解决问题的步骤，并讨论了计量经济学的应用领域和使用的软件工具。

? 第二章是对计量经济学所用到的统计学概念和方法的复习，这些概念和方法对理解本书后面的内容是至关重要的。

我在教学中发现学生学习的主要困难往往不是来自计量经济学本身，而是因为对所用到的大量统计学概念和方法不熟或忘记了。

尽管财经类专业学生都学过概率论和数理统计，但要求学生回过头去将统计学课程全部复习一遍也是不现实的，即便学生这样做了，也往往事倍功半，不得要领。

所以有必要安排这一章，目的是使有一定统计学基础的学生能通过本章的阅读尽快将已经淡忘的知识拣回来，而不必将统计学课程全部复习一遍。

? 第三、四两章是对回归分析方法的介绍。

第三章详尽介绍了双变量线性回归模型的概念和最小二乘估计方法，以及用估计好的模型进行假设检验和预测的方法。

第四章将双变量线性回归模型的结果推广到多元线性回归模型的情形，理论推导借助矩阵代数这一强有力的工具。

西方国家早期的计量经济学本科教学中曾有尽量避开高等数学工具的倾向，这与其经济类学生数学基础薄弱有关，这种倾向在最近已有所改变。

我的教学实践表明，我国经济类学生的高等数学和线性代数知识足以应付回归分析中的绝大部分推导和证明，因此在这两章中给出了比较完整的理论推导和证明。

当然，授课时不一定全部讲授，可留给有兴趣的学生课下参考。

? 第五章讨论回归分析实践中经常碰到的问题和解决的途径，这些问题包括误设定、多重共线性、异方差性和自相关。

传统的方法是将它们分散在若干章节中讲授，本书将它们集中在一起的好处是能加强学生对实践中可能碰到的问题的系统性认识，深入理解各类问题的联系和区别。

? 第六章介绍两类常用的动态经济模型：自回归模型和分布滞后模型。

这一章的内容安排基本遵循传统方法，着重讨论了这两类模型的估计和应用。

? 第七章介绍时间序列分析。

时间序列分析是近年来计量经济学研究取得高速发展的一个领域，以至于西方很多大学的经济系有了为研究生开设时间序列计量经济学课程的要求。

为了跟上这个潮流，有必要在本科计量经济学教学中增加这方面内容的介绍。

显然，要全面介绍时间序列计量经济学的内容，一章的篇幅是远远不够的。

因此，本章着重介绍时间序列分析中用到的一些基本概念，包括非平稳性、单位根、协整等，以及相应的检验方法，使学生对这一领域的研究有一个初步的了解，为进一步的学习和研究打下基础。

? 第八章的内容也基本遵循传统安排，在介绍联立方程模型的概念和术语之后，讨论与联立方程模型有关的数学问题--识别问题，然后着重介绍联立方程模型的估计方法：单方程方法和系统估计方法

<<计量经济学>>

, 以及联立方程模型中最重要的一类模型--宏观计量经济模型。

? 每章教学内容之后, 附有小结, 小结是本章教学中主要内容的概括性总结。

每章最后都附有习题。

?

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 绪论 ? 第一节 什么是计量经济学 ? 第二节 计量经济学方法 ? 第三节 计量经济模型及其应用 ? 第四节 统计和计量经济分析软件 ???第二章 计量经济分析的统计学基础 ? 第一节 概率和概率分布 ? 第二节 统计推断 ? 第三节 参数估计 ? 第四节 假设检验 ??第三章 双变量线性回归模型 ? 第一节 双变量线性回归模型的估计 ? 第二节 最小二乘估计量的性质 ? 第三节 拟合优度的测度 ? 第四节 双变量回归中的区间估计和假设检验 ? 第五节 预测 ? 第六节 有关最小二乘法的进一步讨论 ???第四章 多元线性回归模型 ? 第一节 多元线性回归模型的概念 ? 第二节 多元线性回归模型的估计 ? 第三节 拟合优度 ? 第四节 非线性关系的处理 ? 第五节 假设检验 ? 第六节 预测 ? 第七节 虚拟变量 ?第五章 模型的建立与估计中的问题及对策 ? 第一节 误设定 ? 第二节 多重共线性 ? 第三节 异方差性 ? 第四节 自相关 ?第六章 动态经济模型：自回归模型和分布滞后模型 ? 第一节 引言 ? 第二节 分布滞后模型的估计 ? 第三节 部分调整模型和适应预期模型 ? 第四节 自回归模型的估计 ? 第五节 阿尔蒙多项式分布滞后 ??第七章 时间序列分析 ? 第一节 时间序列分析的基本概念 ? 第二节 平稳性检验 ? 第三节 协整 ???第八章 联立方程模型 ? 第一节 联立方程模型的概念 ? 第二节 识别问题 ? 第三节 联立方程模型的估计 ? 第四节 宏观计量经济模型 ???附录 统计表 ?参考文献

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>