

<<计量经济学中级教程>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学中级教程>>

13位ISBN编号：9787302203575

10位ISBN编号：7302203571

出版时间：2009-8

出版时间：清华大学出版社

作者：潘省初 编

页数：276

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>

<<计量经济学中级教程>>

内容概要

本书的编写思路是：（1）教材内容在广度和深度上都要在本科教材的基础上上一个台阶。具体来说，一是增加一些本科教材中通常不包括的内容，如极大似然法、广义矩方法、ARCH和GARCH模型等；二是对一些本科教材中做过初步介绍的计量经济学专题，如时间序列分析、面板数据模型和受限因变量模型等，进行更全面和更深入的讨论。这两方面的拓展，目的是使硕士研究生对于当前计量经济学的上述重点研究和应用领域的前沿发展有较全面和深入的了解，能够将这些研究成果应用于自己的研究工作。

（2）本书中对上述内容的介绍，又要有别于高级计量经济学教材。本书主要侧重于所涉及理论和方法背后的基本逻辑的直观解释、方法概要、结论和解决问题的具体步骤方面的介绍，而不侧重于这些理论和方法的推导和证明。尽管在介绍中会使用必要的高等数学工具描述相应的概念和结论，但除非确有必要，本书中基本略去严格的数学证明。

<<计量经济学中级教程>>

书籍目录

前言第一章 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 本书的结构 小结 习题第二章 经典线性回归模型 第一节
 线性回归模型的概念 第二节 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 小结 习题 附录 正定矩阵第三章
 经典假设条件不满足时的问题与对策 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 第五节 随机解释变量 小结 习题第四章 极大似然估计和广义矩估计 第
 一节 极大似然估计法 第二节 似然比检验、沃尔德检验和拉格朗日乘数检验 第三节 广义矩
 (GMM) 估计 小结 习题第五章 非线性回归模型 第一节 非线性回归模型 第二节 模型估
 计：迭代法 第三节 模型估计：极大似然法 第四节 非线性回归模型参数假设检验 小结 习题
 第六章 分布滞后模型和自回归模型 第一节 分布滞后模型和自回归模型的概念 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 第六节 格兰杰因果关系检验 小结 习题第七章 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
 小结 习题第八章 时间序列分析 第一节 时间序列分析基本概念 第二节 平稳性检验 第三
 节 Box-Jenkins模型 第四节 RH模型与GRH模型 第五节 协整检验和EM模型 第六节 向量自
 回归(VR)模型 小结 习题第九章 面板数据模型 第一节 面板数据与面板数据模型 第二节
 固定影响模型 第三节 随机影响模型 第四节 SUR模型 第五节 随机系数模型 第六节 动态
 面板数据模型 小结 习题第十章 定性选择模型与受限因变量模型 第一节 线性概率模型 第二
 节 Probit模型和Logit模型 第三节ensored模型 第四节 Truncated模型 小结 习题附录一
 EViews上机指导书 第一部分 EViews简介 第二部分 EViews上机指导附录二 统计表参考文献

章节摘录

第一章 绪论 第一节 什么是计量经济学？

计量经济学 (econometrics) 一词，又译经济计量学，从字面上说，该词含义是经济测量 (economic measurement)，但实际上，其含义要广得多。

下面引用几个比较权威的定义来说明这一点。

1. 计量经济学是一个迅速发展的经济学分支，其目标是给出经济关系的经验内容。

(《新帕尔格雷夫经济学大词典》，1990) 2. 计量经济学可定义为实际经济现象的定量分析，这种分析根据的是由适当推断方法联系在一起的理论和观测的即时发展。

计量经济学运用数理统计知识分析经济数据，对构建于数理经济学基础上的数学模型提供经验支持，并得出数量结果。

(P.A. 萨米尔森等，1954) 3. 计量经济学是将经济理论、数学和统计推断等工具应用于经济现象分析的社会科学。

(A.S. 戈德伯格，1964) 综合以上定义，可以看出，计量经济学是一个有关经济关系的经验估计的经济学分支。

计量经济学依据经济理论，使用数学和统计推断等工具，用观测数据对经济和商务活动进行实证研究，测度和检验经济变量间的经验关系，从而给出经济理论的经验内容，在经济理论的抽象世界和人类活动的具体世界之间搭建桥梁。

<<计量经济学中级教程>>

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>