

# 《计量经济学导论（第三版国际版）》

## 图书基本信息

书名：《计量经济学导论（第三版国际版）》

13位ISBN编号：9787300184677

出版时间：2014-4-30

作者：詹姆斯·H·斯托克（James H.Stock）等

页数：69.00元

译者：张涛,巩书欣

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)

# 《计量经济学导论（第三版国际版）》

## 内容概要

《计量经济学导论(第3版国际版)》的两位作者詹姆斯·H·斯托克与马克·W·沃森都是计量经济学领域的权威，尤其以时间序列的研究最为出众。本书分五篇全面系统地介绍了计量经济学的基本知识，包括：导论与复习、回归分析基础、回归分析的深入专题、时间序列数据的回归分析、回归分析的计量经济学理论。

与其他同类教材相比，《计量经济学导论(第3版国际版)》具有以下几个显著特点：第一，将现实世界的问题和数据与理论的发展联系起来，并且认真对待实证分析中大量的重要发现。第二，所选取的内容反映了现代理论和实践的发展。第三，给出的理论和假设都与应用相符。本书的写作目的是能够指导学生在与初级课程相应的数学水平上熟练的应用计量经济学，可作为本科阶段计量经济学的入门课程来学习使用。

## 作者简介

詹姆斯·H·斯托克，哈佛大学经济系教授，加州大学伯克利分校经济学博士。曾任教于加州大学伯克利分校及哈佛大学肯尼迪政府学院。他的研究领域为经济计量方法、宏观经济预测、货币政策等，是计量经济学领域的权威，尤其擅长时间序列分析的研究。

马克·W·沃森，普林斯顿大学经济系教授，加州大学圣地亚哥分校经济学博士。他的研究领域主要包括：计量经济学的时间序列分析、实证宏观经济学、宏观经济预测等。

## 书籍目录

### 第1篇 导论与复习

#### 第1章 经济问题和数据

- 1.1 我们研究的经济问题
- 1.2 因果效应和理想化实验
- 1.3 数据：来源和类型

本章小结

关键术语

练习A

#### 第2章 概率论综述

- 2.1 随机变量和概率分布
- 2.2 期望值、均值和方差
- 2.3 二维随机变量
- 2.4 正态分布、 $\chi^2$ 分布、学生  $t$  分布和F分布
- 2.5 随机抽样与样本均值分布
- 2.6 抽样分布的大样本近似

本章小结

关键术语

练习A

练习B

附录2.1 重要概念2.3中的结果推导

#### 第3章 统计学综述

- 3.1 总体均值的估计
- 3.2 关于总体均值的假设检验
- 3.3 总体均值的置信区间
- 3.4 不同总体间的均值比较
- 3.5 利用实验数据的因果效应的均值之差进行估计
- 3.6 当样本容量较小时使用‘统计量
- 3.7 散点图、样本协方差和样本相关系数

本章小结

关键术语

练习A

练习B

练习C

附录3.1 美国《当前人口调查》

附录3.2  $Y$ 是  $\mu$  的估计量，最小二乘估计量的两种证明方法

附录3.3 样本方差一致性的证明

### 第2篇 回归分析基础

#### 第4章 一元线性回归

- 4.1 线性回归模型
- 4.2 线性回归模型的系数估计
- 4.3 拟合优度
- 4.4 最小二乘假设
- 4.5 OLS估计量的抽样分布
- 4.6 结论

本章小结

关键术语

练习A

练习B

练习C

附录4.1 加利福尼亚州测试成绩数据集

附录4.2 OLS估计量的推导

附录4.3 OLS估计量的抽样分布

第5章 一元线性回归：假设检验与统计推断

5.1 关于某个回归系数的假设检验

5.2 回归系数的置信区间

.....

第6章 多元线性回归

第7章 多元回归中的假设检验和置信区间

第8章 非线性回归函数

第9章 基于多元回归的评估研究

第3篇 回归分析的深入专题

第10章 面板数据回归

第11章 二元被解释变量回归

第12章 工具变量回归

第13章 实验和准实验

第4篇 时间序列数据的回归分析

第14章 时间序列回归及预测概论

第15章 动态因果效应的估计

第16章 时间序列回归中的其他专题

第5篇 回归分析的计量经济学理论

第17章 一元线性回归理论

第18章 多元回归理论

附录

参考文献

术语表

译后记

## 精彩短评

1、这本书对计量思想的解释更为凝练。。确实是一本可与古扎拉蒂和伍德里奇相媲美的书。

## 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:[www.tushu000.com](http://www.tushu000.com)