

# 《经济计量分析基础》

## 图书基本信息

书名：《经济计量分析基础》

13位ISBN编号：9787513628300

出版时间：2014-1

作者：刘振亚

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)

## 书籍目录

### 第一章 经济计量分析的统计基础

#### 第一节 总体与样本

#### 第二节 总体与样本的桥梁——随机变量

#### 第三节 对总体的描述——随机变量的数字特征

#### 第四节 对样本的描述——样本分布的数字特征

#### 第五节 随机变量的分布——总体和样本的连接点

#### 第六节 通过样本，估计总体（一）——估计量的特征

#### 第七节 通过样本，估计总体（二）——估计量的特征

#### 第八节 通过样本，估计总体（三）——假设检验

#### 第九节 应用实例：最佳持股周期

### 第二章 数据与模型

#### 第一节 数据、模型和变量

#### 第二节 方程形式

#### 第三节 相关系数

### 第三章 最小二乘法：一元线性回归

#### 第一节 拟合直线性质

#### 第二节 拟合优度的评价

#### 第三节 一元线性回归中的计算问题

#### 第四节 应用案例：对资产定价模型（CAPM）的简单检验

### 第四章 最小二乘法与多因素模型——含多个自变量的最小二乘法

#### 第一节 含两个自变量的最小二乘法

#### 第二节 二元回归最小二乘法又探

#### 第三节 从另一个角度看估计系数

#### 第四节 多重共线性

#### 第五节 一般线性回归

### 第五章 古典线性回归模型

#### 第一节 有关 $\beta$ 的古典模型假设

#### 第二节 古典假设的一些内涵

#### 第三节 高斯-马尔科夫定理

#### 第四节 高斯-马尔科夫定理再探

### 第六章 正态条件下回归的推论

#### 第一节 问题的引入

#### 第二节 问题的预解决

#### 第三节 派生的内容：自由度

#### 第四节 回归系数的假设检验

#### 第五节 预测

#### 第六节 复习与提高

### 第七章 假设检验

#### 第一节 t检验：对单个参数检验的方法

#### 第二节 F检验的引入

#### 第三节 一般假设检验：F检验

#### 第四节 F检验的附加例子

#### 第五节 调整后的相关系数

#### 第六节 因果关系检验

#### 第七节 复习与提高

### 第八章 虚拟变量

#### 第一节 运用虚拟变量改变回归直线的截距

- 第二节 运用虚拟变量改变回归直线的斜率
- 第三节 运用虚拟变量同时改变回归直线的截距和斜率
- 第四节 折线回归
- 第五节 复习与提高
- 第九章 计量经济学软件EViews简介
- 第一节 关于计算机的一些基本概念
- 第二节 EViews概述
- 第三节 工作文件的建立及相关操作
- 第四节 基本回归模型
- 第五节 复习与提高
- 第十章 异方差
- 第一节 异方差概述
- 第二节 如何发现异方差
- 第三节 异方差的后沟
- 第四节 异方差的解决方法
- 第十一章 自相关
- 第一节 自相关概述
- 第二节 Durbin-Watson检验
- 第三节 自相关的处理方法
- 第四节 自相关误差下的回归过程
- 第五节 一阶自相关对最小二乘估计量的影响
- 第六节 对含滞后因变量的序列相关模型的检验
- 第七节 DW检验的更为深入的结论
- 第八节 DW显著时的策略
- 第十二章 联系方程模型
- 第一节 概述
- 第二节 内生变量和外生变量
- 第三节 间接最小二乘法
- 第四节 识别问题
- 第五节 识别的充要条件
- 第六节 估计方法
- 第七节 运用最小二乘法估计联立方程组问题
- 第八节 复习与提高
- 第十三章 基于时序动量回报率的量化交易策略
- 附表
- 参考书目

# 《经济计量分析基础》

## 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)