

《计量经济学教程》

图书基本信息

书名：《计量经济学教程》

13位ISBN编号：9787300022215

10位ISBN编号：7300022219

出版时间：1997-03

出版社：中国人民大学出版社

作者：刘振亚

页数：458

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

书籍目录

目录

上篇 计量经济学基础

第一章 计量经济学的统计学基础

第一节 总体、样本和随机函数

第二节 对总体的描述 随机变量的数字特征

第三节 对样本的描述 样本分布的数字特征

第四节 随机变量的分布 总体和样本的连接点

第五节 通过样本，估计总体（一） 估计量的特征

第六节 通过样本，估计总体（二） 估计方法

第七节 通过样本，估计总体（三） 假设检验

第八节 复习与提高

第二章 数据与模型

第一节 数据、变量和模型

第二节 方程形式

第三节 相关系数

第四节 复习与提高

第三章 最小二乘法（一）：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 复习与提高

第四章 最小二乘法（二）：含两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解法又探

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 复习与提高

第五章 古典线性回归模型

第一节 有关 i 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

第五节 复习与提高

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 R^2

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斜率和截距

第四节 折线回归

第五节 复习与提高

第九章 时间序列软件包Micro TSP简介

第一节 有关计算机的一些基本概念

第二节 如何进入Micro TSP

第三节 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 异方差的后果

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 联立方程模型

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

下篇 计量经济学应用

第十三章 变量丢失与变量误加

第一节 解释变量的省略与丢失

第二节 解释变量的误加问题

第三节 调整后的相关系数 R^2

第十四章 虚拟因变量

第一节 线性概率模型和线性辨识模型

第二节 正态模型和逻辑斯特模型

第十五章 误差变量模型

第一节 古典误差变量模型

第二节 含有两个自变量的误差变量模型

第三节 反向回归

第四节 工具变量法

第五节 表征变量

第十六章 预期变量模型

第一节 幼稚预期模型	
第二节 适应性预期模型	
第三节 适应性预期模型的估计问题	
第四节 两个例子	
第五节 预期变量和调整时滞	
第六节 具有适应性预期的部分调整模型	
第七节 另一种分布时滞模型：多项式时滞	
第八节 理性滞后	
第九节 理性预期	
第十节 对理性的检验	
第十一节 在理性预期下需求和供给函数的估计问题	
第十二节 理性预期中的序列相关问题	
第十七章 Micro TSP的一些高级功能简介	
第一节 联立方程系统的估计方法	
第二节 联立方程模型的输入与编辑	
第三节 联立方程模型模拟	
第十八章 如何建立和运用经济计量模型	
第一节 经济计量模型的建模过程及其分析	
第二节 模拟过程	
第三节 模拟模型的评估方法	
第四节 宏观经济计量模型实例（一）	理论模型
与数据收集	
第五节 宏观经济计量模型实例（二）	模型模拟
与参数估计	
第六节 宏观经济计量模型实例（三）	模型预测
与政策分析	
第十九章 经济计量模型的动态行为研究	
第一节 模型的稳定性	
第二节 模型的动态响应行为	
第三节 动态脉冲响应函数与向量自相关	
第四节 经济计量模型的修正与调整	
第五节 随机模拟	
第六节 有限数据的构模方法	
第二十章 诊断检验、模型选择与限定检验	
第一节 基于最小二乘残差的诊断检验	
第二节 最小二乘残差的一些问题	
第三节 其它类型的拟合残差	
第四节 异常点的寻找方法	
第五节 模型选择	
参考书目	
附表	

精彩短评

1、第一次学计量经济学时 刘老师推荐自己的书

《计量经济学教程》

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:www.tushu000.com