

# 《计量经济学原理》

## 图书基本信息

书名：《计量经济学原理》

13位ISBN编号：9787300193420

出版时间：2014-6

作者：彼得·肯尼迪

页数：553

译者：周尧,张伟

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)

# 《计量经济学原理》

## 内容概要

《计量经济学原理》对所有计量经济学学生来说都是完美（并且重要）的工具——不管是一年级本科生，还是硕士一年级学生，抑或博士。这解释了为何教科书中会继续充斥着证明和公式。书中包含了直觉判断、质疑批评、真知灼见、插科打诨和实操建议（推荐与劝阻）。第六版中加入了新篇章，包括工具变量和计算问题，并对GMM和非参数估计方法给出了更多信息。新版还加入了小波分析的内容。

计量经济学以经济理论和统计数据为基础，运用数学和统计学方法，以建立经济计量模型为主要手段，定量分析研究经济变量之间的关系。本书用简洁、准确的语言全面总结了计量经济学的主要内容和最新发展。与传统的教材不同，在陈述和解释各种计量模型时，作者特别强调对计量经济学、基本概念和技术过程的直觉感受，而将进一步讨论的细节和技术材料，都分别归入每章之后的“一般性注释”和“技术性注释”中，从而保证了非常好的可读性。本书已经被公认为是世界各地师生首选的教科书。通过本书的学习，读者可以系统地掌握现代计量经济学的基本原理和基本方法，并且具备一定的建立计量经济学模型进行实证研究的能力。

# 《计量经济学原理》

## 作者简介

彼得·肯尼迪（Peter Kennedy）是Simon Fraser大学的经济学教授。除《计量经济学指南》外，他还著有《宏观经济学精要：了解新闻中的经济学》（第二版，2000），同时他担任了《国际预测期刊》、《经济学教育期刊》和《经济学公报》的副主编。

## 书籍目录

### 第1章 引言

- 1.1 什么是计量经济学
- 1.2 干扰项
- 1.3 估计和估计量
- 1.4 良好和首选的估计量

一般性注释

技术性注释

### 第2章 估计量标准

- 2.1 引言
- 2.2 计算成本
- 2.3 最小二乘
- 2.4 R 最大
- 2.5 无偏性
- 2.6 有效性
- 2.7 均方误差 (MSE)
- 2.8 渐近性
- 2.9 最大似然
- 2.10 蒙特卡洛研究
- 2.11 总结

一般性注释

技术性注释

### 第3章 经典线性回归模型

- 3.1 作为一览表的教科书
- 3.2 五个假设
- 3.3 CLR模型中的OLS估计量

一般性注释

技术性注释

### 第4章 区间估计和假设检验

- 4.1 引言
- 4.2 单一假设的检验：t检验
- 4.3 联合假设的检验：F检验
- 4.4 参数向量的区间估计
- 4.5 LR, W和LM统计量
- 4.6 自举法

一般性注释

技术性注释

### 第5章 设定

- 5.1 引言
- 5.2 三种方法
- 5.3 设定的一般原理
- 5.4 错误设定检验/诊断
- 5.5 再说 R

一般性注释

技术性注释

### 第6章 违反假设一：错误回归元，非线性和参数非常数

- 6.1 引言
- 6.2 错误的自变量集

6.3 非线性

6.4 变化的参数值

一般性注释

技术性注释

第7章 违反假设二：干扰项的期望非零

不变的非零均值

零截距

有限因变量

边界生产函数

对数变换

一般性注释

第8章 违反假设三：非球状干扰项

8.1 引言

8.2 违背的后果

8.3 异方差

8.4 自相关干扰项

8.5 广义矩法

一般性注释

技术性注释

第9章 违反假设四：工具变量

9.1 引言

9.2 IV估计量

9.3 IV方法的问题

一般性注释

技术性注释

第10章 违反假设五：测量误差和自回归

10.1 变量中的误差

10.2 自回归

一般性注释

技术性注释

第11章 违反假设六：联立方程

11.1 引言

11.2 识别

11.3 单方程方法

11.4 系统方法

一般性注释

技术性注释

第12章 违反假设七：多重共线性

12.1 引言

12.2 后果

12.3 检测多重共线性

12.4 对策

一般性注释

技术性注释

第13章 引入外部信息

13.1 引言

13.2 确定约束条件

13.3 随机约束条件

13.4 预检验估计量

## 13.5 外部信息与MSE

一般性注释

技术性注释

## 第14章 贝叶斯方法

### 14.1 引言

### 14.2 什么是贝叶斯分析

### 14.3 贝叶斯方法的优点

### 14.4 克服实践者的怨言

一般性注释

技术性注释

## 第15章 虚拟变量

### 15.1 引言

### 15.2 解释

### 15.3 加入其他定性变量

### 15.4 与定量变量的相互影响

### 15.5 特定观测值虚拟变量

一般性注释

技术性注释

## 第16章 定性因变量

### 16.1 二分因变量

### 16.2 多分因变量

### 16.3 有序logit/probit模型

### 16.4 计数

一般性注释

技术性注释

## 第17章 有限因变量

### 17.1 引言

### 17.2 Tobit模型

### 17.3 样本选择

### 17.4 久期模型

一般性注释

技术性注释

## 第18章 面板数据

### 18.1 引言

### 18.2 允许不同的截距

### 18.3 固定与随机效应

### 18.4 短期和长期

### 18.5 长而窄的面板数据

一般性注释

技术性注释

## 第19章 时间序列计量经济学

### 19.1 引言

### 19.2 ARIMA模型

### 19.3 向量自回归 (VAR)

### 19.4 误差修正模型

### 19.5 单位根检验

### 19.6 协整

一般性注释

技术性注释

## 第20章 预测

### 20.1 引言

### 20.2 因果预测/计量经济学模型

### 20.3 时间序列分析

### 20.4 预测准确性

一般性注释

技术性注释

## 第21章 稳健估计

### 21.1 引言

### 21.2 异常值和有影响的观测值

### 21.3 消除有影响的观测值因素

### 21.4 人工神经网络

### 21.5 非参数估计

一般性注释

技术性注释

## 第22章 应用计量经济学

### 22.1 引言

### 22.2 应用计量经济学的十条圣训

### 22.3 获得了错误的符号

### 22.4 普遍错误

### 22.5 实践者需要了解什么

一般性注释

技术性注释

## 第23章 计算的问题

### 23.1 引言

### 23.2 最优化与计算机搜索

### 23.3 积分估计与模拟

### 23.4 奇异分布抽样

一般性注释

技术性注释

## 附录A 抽样分布——统计的基础

## 附录B 关于方差

## 附录C 渐近理论入门

## 附录D 习题

## 附录E 编号为偶数的题目答案

难词表

词汇表

# 《计量经济学原理》

## 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)