

# 《计量经济学》

## 图书基本信息

书名：《计量经济学》

13位ISBN编号：9787550400627

10位ISBN编号：7550400628

出版时间：2011-3

出版社：靳庭良 西南财经大学出版社 (2011-03出版)

作者：靳庭良

页数：313

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》

## 内容概要

《计量经济学》是适合于经济学、管理学门类各专业高年级本科生和非数量经济学专业低年级研究生使用的一部计量经济学专著性教材，也可以作为在社会、经济、管理等领域从事计量经济分析的研究人员的参考书。该书系统介绍了经典计量经济学的基本理论、方法，以及为避免“伪回归现象”的发生而发展起来的协整理论的基本内容，并将它们纳入一个完整的体系之中。全书共分八章：第1章是绪论，主要介绍了什么是计量经济学以及计量经济学研究问题的基本步骤；第2、3章介绍了经典一元和多元线性回归模型的基本理论、方法及其在经济分析中的应用，以及可线性化的非线性回归模型的估计问题；第4章是关于违背基本假定条件的线性回归模型的讨论，包括多重共线性、异方差性、自相关性和随机解释变量问题等；第5章是关于模型设定的几个专门问题，包括解释变量选取的偏误、线性约束的F检验、模型选择的准则和虚拟解释变量模型等；第6章介绍了分布滞后变量模型的基本理论和方法；第7章是关于联立方程模型的讨论；第8章讨论了单位根检验、协整检验和误差修正模型的建立问题。

# 《计量经济学》

## 书籍目录

绪论 § 1.1 什么是计量经济学1.1.1 什么是计量经济学1.1.2 计量经济模型1.1.3 经典计量经济学与非经典  
计量经济学 § 1.2 经典计量经济学的建模步骤1.2.1 理论模型的设定1.2.2 变量数据的搜集与处理1.2.3 模  
型参数的估计1.2.4 模型的检验 § 1.3 计量经济模型的应用1.3.1 结构分析1.3.2 经济预测.1.3.3 政策评价  
§ 1.4 阅读本书需要的数学知识练习题2一元线性回归模型 § 2.1 回归分析与回归模型2.1.1 回归分析与回  
归模型2.1.2 引入随机误差项的原因 § 2.2 基本概念及普通最小二乘法2.2.1 基本概念2.2.2 普通最小二乘  
法 § 2.3 总体回归模型的基本假定及OLS估计量的统计性质2.3.1 基本假定2.3.2 OLS估计量的统计性  
质2.3.3 随机误差项方差的OLS估计量 § 2.4 拟合优度的度量2.4.1 可决系数 ( $R^2$ ) 2.4.2 相关系数与 $R^2$ 的  
关系 § 2.5 回归系数的假设检验及其区间估计2.5.1 OLS估计量的概率分布2.5.2 变量的显著性检验2.5.3 回  
归系数的区间估计 § 2.6 预测2.6.1 点预测2.6.2 区间预测2.6.3 预测精度的影响因素分析 § 2.7 案例分析练  
习题二附录2.1 回归系数OLS估计量的最小方差性证明附录2.2 的OLS估计量的无偏性证明3, 多元线性  
回归模型 § 3.1 基本概念及普通最小二乘法3.1.1 基本概念3.1.2 普通最小二乘法 § 3.2 总体回归模型的基  
本假定及OLS估计量的统计性质3.2.1 基本假定3.2.2 OLS估计量的统计性质3.2.3 随机误差项方差的OLS估  
计量 § 3.3 可决系数与调整的可决系数3.3.1 可决系数 ( $R^2$ ) 3.3.2 调整的可决系数 ( $R^2$ ) § 3.4 变量的显  
著性检验及偏回归系数的区间估计3.4.1 变量的显著性检验3.4.2 偏回归系数的区间估计 § 3.5 预测3.5.1  
点预测2.5.2 区间预测 § 3.6 可线性化的非线性回归模型3.6.1 几种常见的模型3.6.2 模型的估计与预测  
§ 3.7 案例分析.....4 违背基本假定的多元线性回归模型5 模型定中的几个专题6 滞后变量模型7 联立方  
程模型8 伪回归现象与协整理论附录

## 章节摘录

版权页：插图：本章首先介绍回归分析的基本思想及回归模型的基本概念，然后讨论只包含一个解释变量的简单回归模型——一元线性回归模型的情形。具体内容包括：参数的估计方法（普通最小二乘法）、普通最小二乘估计量的统计性质、拟合优度的度量、统计假设检验、模型在预测方面的应用，最后一部分是案例分析。我们这样做并不是因为一元线性回归模型的实用性，而是它能使回归分析的基本思想表述得尽可能简单，而且某些基本概念可以用几何图形来说明。不仅如此，对于含有多个解释变量的线性回归模型（多元线性回归模型）许多方面的讨论都是本章相应内容的简单推广。计量经济学的许多方法论都是建立在回归分析的基础之上。所谓回归分析是研究一个变量（被解释变量或因变量）对另一个或多个可控变量（解释变量或自变量）数量依赖关系的数学分析方法，其目的在于通过解释变量的已知值或设定值，去估计被解释变量的平均值，或分析解释变量的变动对被解释变量产生的影响。这里所谓可控变量是指在实验之前实验者能设定其取值，而且可在重复抽样中取相同的值的变量，这类变量也被称为确定性变量。比如，在研究经济问题时，政府支出、税率、存款准备金率等政策变量都属于可控变量。又如，在研究某一社区人们的消费支出问题时，可以提前设定被调查者的收入层次（或水平），对于一定收入（如月收入3000元）的个人进行重复抽样得到他们的消费支出数据，此时人们的收入就是一个可控变量。再如，研究某一行业中企业的产量问题，企业的资本、劳动力数量都可以看做是可控变量。而从宏观上研究一个国家（如中国、美国等）的居民消费支出问题时，国民总收入与总消费支出一样都是随机变量，它们的取值是由该国的经济运行环境同时决定的，此时国民总收入就不能看作一个可控变量。

# 《计量经济学》

## 编辑推荐

《计量经济学》为21世纪高等院校经济管理类核心课程规划教材之一。

## 精彩短评

1、 用过很多版本的计量经济学，但本书却有自己独特的一面：

(1) 本书将经典计量经济学与通常被归为“非经典计量经济学”的时间序列分析中的协整理论一起构成一个比较完整的体系进行介绍。

(2) 本书重视对各种方法适用性的说明，以澄清有的教科书对一些方法的模糊认识。

(3) 本书在吸收国内外优秀教材的基础上，依据现实经济数据，使案例分析中的问题多样化，既有宏观的经典问题，也包括易于激发学生学习兴趣的微观实际问题，而且在分析过程中尽可能使学生领悟应用计量经济学方法研究实际经济问题的基本步骤和要点。

(4) 本书将图示法与Dolado (1990) 提出的检验程序相结合，给出了一种具有一定理论依据且操作性较强的ADF (DF) 单位根检验程序。

(5) 本书在正文中介绍完一种检验或估计方法后，单独在一个“方框”中给出该方法在EViews软件下的执行过程，而将EViews软件的基本操作程序放在书末的附录中。

(6) 本书在习题的配置上，除包括一些复习重要的理论和概念问题、熟悉基本方法的应用题外，相当一部分问题是对各章所讲内容的延伸，或对已分析过的问题的进一步思考。

2、 听说这个很难，书还不错

1、用过很多版本的计量经济学，但本书却有自己独特的一面：（1）本书将经典计量经济学与通常被归为“非经典计量经济学”的时间序列分析中的协整理论一起构成一个比较完整的体系进行介绍。（2）本书重视对各种方法适用性的说明，以澄清有的教科书对一些方法的模糊认识。（3）本书在吸收国内外优秀教材的基础上，依据现实经济数据，使案例分析中的问题多样化，既有宏观的经典问题，也包括易于激发学生学习兴趣的微观实际问题，而且在分析过程中尽可能使学生领悟应用计量经济学方法研究实际经济问题的基本步骤和要点。（4）本书将图示法与Dolado（1990）提出的检验程序相结合，给出了一种具有一定理论依据且操作性较强的ADF（DF）单位根检验程序。（5）本书在正文中介绍完一种检验或估计方法后，单独在一个“方框”中给出该方法在EViews软件下的执行过程，而将EViews软件的基本操作程序放在书末的附录中。（6）本书在习题的配置上，除包括一些复习重要的理论和概念问题、熟悉基本方法的应用题外，相当一部分问题是对各章所讲内容的延伸，或对已分析过的问题的进一步思考。

## 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)