

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787565402760

10位ISBN编号：7565402761

出版时间：2011-2

出版时间：东北财经大学出版社有限责任公司

作者：陶长琪

页数：323

字数：485000

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：<http://www.tushu007.com>

<<计量经济学>>

内容概要

通过本课程学习，了解计量经济学作为一门独立学科的主要思想和原理，在掌握基本的经典计量经济学理论与方法的基础上，进一步掌握非经典的计量经济学理论与方法，主要是计量经济学在模型结构、估计方法和数据类型方面的扩展。

学会运用理论和分析软件，建立计量经济模型，对现实经济问题、金融现象和市场行为展开实证分析，并给出具有经济含义的解释。

本教材内容主要包括：(1)线性回归模型，包括一元和多元线性回归模型的参数估计与统计检验；(2)违背经典模型假定的单方程计量经济学模型，主要有多重共线性、异方差性、自相关和随机解释变量问题；(3)联立方程计量经济学模型的概念、识别、估计和检验；(4)特殊变量问题，包括虚拟变量、工具变量、分布滞后变量、随机解释变量等(5)非线性方程模型，包括Logistic模型、Probit模型、Tobit模型等；(6)时间系列模型分析，包括ARMA模型、协整与误差；(7)面板数据模型与应用，包括面板数据回归模型、混合回归模型、固定效应回归模型、随机效应回归模型、变系数回归模型、Hausman检验等。

<<计量经济学>>

书籍目录

第1章 绪论

学习目标

- 1.1 计量经济学的定义
- 1.2 计量经济学的发展简史
- 1.3 计量经济学的概率方法
- 1.4 计量经济学模型
- 1.5 理论计量经济学与应用计量经济学
- 1.6 应用计量经济学的研究步骤

本章小结

习题

第2章 统计基础知识

学习目标

- 2.1 数据特征数
- 2.2 总体特征数的点估计与区间估计
- 2.3 参数估计
- 2.4 假设检验
- 2.5 经济指数

本章小结

习题

第3章 一元线性回归模型(经典假定下)

学习目标

- 3.1 回归分析概述
- 3.2 一元线性回归的总体回归方程与样本回归方程”
- 3.3 一元线性回归模型的参数估计(经典假定下)
- 3.4 一元线性回归模型的统计检验
- 3.5 一元线性回归模型的预测
- 3.6 案例分析

本章小结

习题

第4章 多元线性回归模型

学习目标

- 4.1 多元线性回归模型及假定
- 4.2 多元线性回归模型的参数估计
- 4.3 多元线性回归模型的统计检验
- 4.4 多元线性回归模型的置信区间
- 4.5 受约束回归
- 4.6 案例分析

本章小结

习题

第5章 异方差性

学习目标

- 5.1 异方差的概念
- 5.2 异方差的后果
- 5.3 异方差的检验
- 5.4 异方差的修正

<<计量经济学>>

本章小结

习题

第6章 自相关性

学习目标

6.1 自相关性的基本知识

6.2 自相关性产生的原因与后果

6.3 自相关性的检验

6.4 自相关性的解决方法

6.5 自相关系数的估计

6.6 案例分析

本章小结

习题

第7章 多重共线性

学习目标

7.1 多重共线性的产生及后果

7.2 多重共线性的检验

7.3 多重共线性的处理

本章小结

习题

第8章 特殊变量

学习目标

8.1 虚拟变量

8.2 随机解释变量

8.3 滞后变量

本章小结

习题

第9章 联立方程模型

学习目标

.....

第10章 非线性方程模型

第11章 时间序列分析

第12章 面板数据模型与应用

参考文献

附录 统计分布表

<<计量经济学>>

章节摘录

版权页：插图：学习目标知识目标：了解联立方程模型的设定，理解内生变量和外生变量、结构方程和行为方程、结构式和简化式、联立方程的偏误，熟练掌握模型识别的阶条件和秩条件及方程估计的方法。

技能目标：能够利用计量软件处理联立方程模型的问题。

能力目标：能够对现实中的经济问题建立正确的联立方程模型，能运用相关计量分析软件进行估计和各种检验，并能对估计结果进行合理分析和解释。

经济模型的建立是为了对现实经济现象进行更好的描述和解释，它可以帮助我们理解其运行机制，并对其发展的未来路径进行预测。

而在宏观经济学中，存在着一种类似“是先有鸡还是先有蛋”的争论，即究竟是物价上涨导致货币供应量增加，还是货币供应量增加导致物价上涨。

在学术界，一些经济学家认为货币供应量是通货膨胀的主要原因。

通货膨胀表现出的经济现象是物价上涨，而物价上涨的直接原因就是货币供应量超过了货币需求量。

正如经济学家米尔顿·弗里德曼曾指出的：“通货膨胀永远而且处处是一种货币现象。

”也有一些经济学家则不认同这一观点，他们认为货币需求的多少取决于人们所购买的物品与劳务的价格，价格越高，进行交易所需要的货币则越多，即物价水平上升增加了货币需求量，从而使得货币供应量增加。

货币供应量、经济增长及通货膨胀的关系在各国政府和货币当局中也是一直饱受争论的问题。

在出现通货膨胀时，政府强调是货币当局发放的货币过多，使得总需求中的投资和消费增长过快，导致了通货膨胀；而货币当局则认为这是由于经济增长过快，引起投资和消费对货币需求的增长，才引起物价水平上升，从而迫使货币供应量增加。

为了建立经济模型来验证这种争论，有人主张建立货币供应量影响物价水平和经济增长的方程；也有人主张建立物价水平和经济增长影响货币供应量的方程。

到底是建立哪一个方程？

还是同时建立两个方程？

这两个方程是什么关系？

当样本数据都是既定时，两个方程可以同时估计吗？

<<计量经济学>>

编辑推荐

《计量经济学》是21世纪高等院校公共课精品教材·江西省高等学校精品课程教材。

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:<http://www.tushu007.com>