

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787040316384

10位ISBN编号：7040316382

出版时间：2011-6

出版时间：高等教育出版社

作者：王少平//杨继生//欧阳志刚

页数：348

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

《计量经济学》以学生“愿意学、学得懂、愿意用”为导向，介绍计量经济学的基本内容及其发展，同时基于我国实际的数据、例子以及仿真实验讲述重要理论和概念，并以适当的尤式进行引申和扩展，由此形成了“学生有兴趣学、学了能应用”的教学内容和讲述方式。

全书以总体回归模型和样本回归模型及其相互关系为基点，首先讲述样本回归模型及其估计和估计量的性质、假设检验，进而通过仿真实验直观讲解估计量的性质；在此基础上，通过例题重点讲述模型设定，讨论现实数据不满足若干经典假设条件的检验与校正的思想。

其次，简洁直观地讲述了离散选择模型，并以通俗易懂、重在解析其研究思想的方式讲述平稳和非平稳的时间序列模型及其应用。

最后，以例子讲述面板数据模型的特点、面板数据模型的估计和检验，并以言简意赅的方式讲述动态面板数据模型。

《计量经济学》适用于高等学校经济类、管理类各专业计量经济学的本科生教材，也可以作为经济类学科方向的硕士、博士研究生及相关科研人员学习和应用计量经济学的参考书。

<<计量经济学>>

书籍目录

第1章 引论 § 1.1 计量经济学的定义与应用一、计量经济学的定义与学科特性二、计量经济学的作用与功能 § 1.2 计量经济学的学科地位一、计量经济学在经济学科中居于最重要的地位二、计量经济学是经济学的一个分支学科三、计量经济学的分类 § 1.3 计量经济学中的主要概念与含义一、计量经济学与计量经济模型二、被解释变量与解释变量三、模型的估计和检验四、数据 § 1.4 如何学习计量经济学本章小结讨论与思考题练习题第2章 回归分析 § 2.1 总体与总体回归模型一、总体与总体回归模型的含义二、总体回归模型中的包含的内容 § 2.2 样本与样本回归模型一、样本与样本回归模型的含义二、样本回归模型的估计——最小二乘法的基本原理 § 2.3 总体回归模型和样本回归模型——基于蒙特卡罗实验的再认识本章小结讨论与思考题练习题第3章 一元线性回归模型 § 3.1 一元线性回归模型参数的估计一、基本假定二、普通最小二乘法 (OLS) 三、最小二乘估计量的统计性质 § 3.2 拟合优度一、总离差平方和的分解二、拟合优度 § 3.3 回归参数的区间估计和假设检验一、回归参数估计量的概率分布二、回归参数的区间估计三、变量的显著性检验：t检验四、检验统计量的p值 § 3.4 例子：中国消费函数一、模型估计与结果说明二、模型应用 § 3.5 对最小二乘估计量统计性质的直观认识——蒙特卡罗模拟本章小结讨论与思考题练习题附录：OLS的无偏估计量第4章 多元线性回归分析 § 4.1 多元线性回归模型一、两个例子二、多元线性回归模型的一般形式三、偏效应 § 4.2 多元线性回归模型的OLS估计一、回归系数的估计二、随机误差项方差的估计三、判定系数的调整 § 4.3 多元线性回归模型的假设检验一、假设检验的基本思想二、单参数的显著性检验三、多参数的线性约束检验.....第5章 模型设定 第6章 多元线性回归的向量表述 第7章 多重共线性 第8章 异方差 第9章 自相关 第10章 离散选择模型 第11章 联立方程模型 第12章 平稳时间序列模型 第13章 非平稳时间序列模型 第14章 面板数据模型

章节摘录

版权页：插图：在多元线性回归分析中，有一个经典假设：解释变量之间不存在完全的多重共线性，即任何一个解释变量不能表示为其他解释变量的线性组合。

如果某一个解释变量能够被其他解释变量的线性组合表示，就意味着解释变量之间具有完全多重共线性。

在实际应用中，多元线性回归模型中的解释变量之间往往存在不同程度的线性相关关系，这就是所谓的不完全多重共线性。

本章将对多重共线性的概念和有关问题进行讲解和诠释，具体内容包括：多重共线性的概念、产生多重共线性的原因、多重共线性对OLS估计量的影响以及对多重共线性现象的侦察和补救措施等。

§ 7.1 多重共线性的概念 多重共线性是针对多元线性回归模型中的多个解释变量之间的相关性而提出的概念。

在多元线性回归模型中，经典假设要求模型的各解释变量之间不存在完全的线性关系，即不存在完全的多重共线性。

而在实际经济分析中，当解释变量的观测值之间存在或多或少的相关性时，则认为模型存在不完全的多重共线性。

因此，严格地讲，多重共线性包含完全的多重共线性和不完全的多重共线性，但在未加特别说明的时候，通常所说的多重共线性是指不完全的多重共线性。

<<计量经济学>>

编辑推荐

《计量经济学》是普通高等教育“十一五”国家级规划教材,国家级精品课程教材,高等学校经济学类核心课程教材之一。

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>