

<<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

出版时间：中国人民大学出版社

作者：刘振亚

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>

## &lt;&lt;计量经济学教程&gt;&gt;

## 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  $R^2$

## &lt;&lt;计量经济学教程&gt;&gt;

- 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<sup>2</sup>
- 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

## &lt;&lt;计量经济学教程&gt;&gt;

- 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



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