

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787300072043

10位ISBN编号：7300072046

出版时间：2006-4

出版单位：人民大学

作者：潘省初

页数：380

字数：448000

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

本书分四个部分共12章。

第一部分包括第1章至第3章，介绍了计量经济学的基础及数据处理方法，主要内容有：在经济学、金融学以及保险学中占有重要地位的随机变量数字特征，如数学期望、方差、相关系数和变异系数等。此外，本部分还介绍了数据的平滑技术和统计推断的基本问题。

第二部分包括第4章至第6章，介绍了经典假设条件下的线性模型，主要内容有：一元线性回归、多元性回归及虚拟变量的回归模型。

第三部分包括第7章至第10章，介绍了不满足经典假设条件下的线性模型，主要内容有：产生多重共线性的原因及后果，如何发现及处理；产生异方差的原因，如何检验及校正；自相关分析和分布滞后模型。

此外，本部分还结合一些实例讨论了联立方程模型的性质和特点。

第四部分包括第11章和第12章，介绍了动态模型和应用模型。

<<计量经济学>>

作者简介

潘省初，现任中央财经大学统计学院教授，博士生导师。
1969年毕业于北京大学数学力学系，1983年毕业于清华大学经济管理工程系，获工学硕士学位。
1983年起在中央财经大学任教至今，其间曾赴英国利物浦大学、剑桥大学和美国马里兰大学做访问学者或进行合作研究，历时两年。

书籍目录

第一章 概率论基础 第一节 随机现象、随机试验和随机事件 第二节 事件的频率与概率 第三节 条件概率与事件的独立性 第四节 随机变量及其分布 第五节 二维随机变量 第六节 随机变量的数字特征 第七节 随机变量的矩 第二章 矩阵代数 第一节 矩阵及其运算 第二节 线性方程组 第三节 二次型与正交变换 第三章 数据分析方法与参数统计推断 第一节 数据的分析方法 第二节 抽样分布 第三节 参数的统计推断 第四节 方差分析方法 第四章 一元线性回归 第一节 一元线性回归分析 第二节 线性回归的方差分析 第三节 t检验（直接检验法） 第四节 相关系数及其显著性检验 第五节 回归分析的其他问题 第五章 多元线性回归 第一节 经典多元线性回归模型的概念 第二节 最小平方估计 第三节 估计量的性质 第四节 极大似然估计 第五节 假设检验 第六节 区间估计 第七节 预测 第六章 虚拟变量的回归模型 第一节 虚拟变量 第二节 虚拟变量的应用 第七章 多重共线性 第一节 多重共线性的概念及原因 第二节 多重共线性的后果 第三节 如何发现多重共线性 第四节 如何对多重共线性进行补救 第八章 异方差性 第一节 异方差概念 第二节 出现异方差时的OLS估计 第三节 异方差的检验 第四节 异方差的校正 第九章 自相关分析 第十章 联立方程模型 第十一章 时间序列分析 第十二章 应用计量经济模型附表参考文献

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>