

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787300107127

10位ISBN编号：7300107125

出版时间：2009-6

出版时间：中国人民大学出版社

作者：潘省初

页数：263

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>

## 前言

本书第二版的编写至今已近三年，在此期间，计量经济学的研究、应用和教材编写方面都有很多新的进展，有必要将这些进展反映到我们的教材中。

同时，经过两年多的教学实践，也发现了原书的一些不足之处，应出版社之邀，再次对原书进行修订。

本书第三版主要在以下几方面对第二版进行了调整和修改：1.在保留第二版基本结构的基础上，做了一些局部的结构调整，去掉了原第三章第六节“有关最小二乘法的进一步讨论”，将其中部分内容并入第五章新增的“随机解释变量”一节中；将第三章第七节“极大似然法”移至第四章作为第八节，并将原第四章第五节中有关LR、W和LM检验法的讨论并入该节；第七章中将误差修正模型变为一节。

这些结构上的调整旨在使相关内容的衔接更加紧凑，全书结构更加合理。

2.跟踪计量经济学研究的最新成果和国内外优秀教科书的最新版本，修订本书中一些相对陈旧的内容和过时的方法，是本次修订的主要目标。

重点修改了LR、W和LM检验法、异方差性的检验、解决异方差性和自相关问题方法、平稳性检验方法、伪回归的概念和多项选择模型等方面的内容。

3.对第二版中表达不够准确和不够清晰之处进行了修改。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 内容概要

本书第二版的编写至今已近三年，在此期间，计量经济学的研究、应用和教材编写方面都有很多新的进展，有必要将这些进展反映到我们的教材中。

同时，经过两年多的教学实践，也发现了原书的一些不足之处，应出版社之邀，再次对原书进行修订。

本书第三版主要在以下几方面对第二版进行了调整和修改：1.在保留第二版基本结构的基础上，做了一些局部的结构调整，去掉了原第三章第六节“有关最小二乘法的进一步讨论”，将其中部分内容并入第五章新增的“随机解释变量”一节中；将第三章第七节“极大似然法”移至第四章作为第八节，并将原第四章第五节中有关LR、W和LM检验法的讨论并入该节；第七章中将误差修正模型变为一节。

这些结构上的调整旨在使相关内容的衔接更加紧凑，全书结构更加合理。

2.跟踪计量经济学研究的最新成果和国内外优秀教科书的最新版本，修订本书中一些相对陈旧的内容和过时的方法，是本次修订的主要目标。

重点修改了LR、W和LM检验法、异方差性的检验、解决异方差性和自相关问题方法、平稳性检验方法、伪回归的概念和多项选择模型等方面的内容。

3.对第二版中表达不够准确和不够清晰之处进行了修改。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 绪论第一节 什么是计量经济学第二节 计量经济学方法第三节 计量经济模型及其应用第四节 统计和计量经济分析软件小结习题第二章 计量经济分析的统计学基础第一节 概率和概率分布第二节 统计推断第三节 参数估计第四节 假设检验小结习题第三章 双变量线性回归模型第一节 双变量线性回归模型的估计第二节 最小二乘估计量的性质第三节 拟合优度的测度第四节 双变量回归中的区间估计和假设检验第五节 预测小结习题第四章 多元线性回归模型第一节 多元线性回归模型的概念第二节 多元线性回归模型的估计第三节 拟合优度第四节 非线性关系的处理第五节 假设检验第六节 预测第七节 虚拟变量第八节 极大似然估计小结习题附录：正定矩阵第五章 模型的建立与估计中的问题及对策第一节 误设定第二节 多重共线性第三节 异方差性第四节 自相关第五节 随机解释变量小结习题第六章 动态经济模型：自回归模型和分布滞后模型第一节 引言第二节 分布滞后模型的估计第三节 部分调整模型和适应预期模型第四节 自回归模型的估计第五节 阿尔蒙多项式分布滞后第六节 格兰杰因果关系检验小结习题第七章 时间序列分析第一节 时间序列分析的基本概念第二节 平稳性检验第三节 协整第四节 误差修正模型小结习题第八章 联立方程模型第一节 联立方程模型的概念第二节 识别问题第三节 联立方程模型的估计第四节 宏观计量经济模型小结习题第九章 面板数据模型第一节 面板数据与面板数据模型第二节 表面不相关回归第三节 固定影响模型第四节 随机影响模型小结习题第十章 定性选择模型第一节 线性概率模型第二节 Probit模型和Logit模型第三节 多项选择模型小结习题附录统计表参考文献

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 章节摘录

插图：第二章计量经济分析的统计学基础本章对计量经济学所用到的统计学概念和方法作一概括性的回顾，这些概念和方法对理解本书后面的内容是至关重要的。

当然，由于篇幅的限制，这一章的内容并没有覆盖统计学（或概率论和数理统计）的全部理论和方法，讨论也难以做到十分详尽。

它仅仅是一种复习性的介绍，目的是使有一定统计学基础的学生能通过本章的学习尽快将已经淡忘的知识捡回来，而不必回过头去将统计学课程全部复习一遍。

第一节 概率和概率分布 一、描述性统计量 假设你手头有一个数据集，包含若干个变量的数据。

为了概括这些数据的特征，引进统计量的概念。

这些统计量被用来测度单个变量的典型值和该变量的观测值之间的变差，或者两个变量之间的相关程度。

统计量是根据一个给定数据集中变量的值计算的一个测度。

<<计量经济学>>

编辑推荐

《计量经济学(第3版)》为通用经济系列教材之一。

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>