

<<计量经济学导论>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学导论>>

13位ISBN编号：9787300123196

10位ISBN编号：7300123198

出版时间：2010-6

出版时间：中国人民大学出版社

作者：杰弗里·M·伍德里奇

页数：825

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>

<<计量经济学导论>>

前言

我之所以编写《计量经济学导论》的第一版，是因为我看到本科生开设的计量经济学与经验研究者所考虑和应用的计量经济模型之间，存在着相当大的差距。

我越来越相信，从计量经济学专业人士的视角来讲授计量经济学导论，不仅使这个学科更有意思，而且实际上讲解起来更加简单。

从读者对前三版的肯定来看，我的直觉是正确的。

尽管背景和兴趣各异，所教的学生也千差万别，但越来越多的教师开始信奉本书所倡导的计量经济学现代视角。

我们仍然强调计量经济学在实际问题中的应用。

每个计量经济方法都是研究者在分析非实验数据时所遇到的某个特定问题激发而来。

本书的主要内容是，根据实际经验应用来理解和解释计量经济学中的假定；本书所需要的数学不超过大学所学的线性代数和基础概率统计。

适合于目前计量经济学教师的组织结构。第四版保留了第三版的总体结构。

本书区别于绝大多数其他教科书最显著的特征是，它的篇章结构是根据分析数据的类型而进行划分的。

这与传统方法明显不同，因为传统分析总是先提出一个线性模型，并列以后分析中可能需要的所有假定，然后在与那些假定之间的联系不甚清晰的情况下，证明或得出一些结论。

我的方法是，在第1篇中，首先在随机抽样的假定下，用横截面数据讨论多元回归分析。

<<计量经济学导论>>

内容概要

本书主要是根据实际经验应用来理解和解释计量经济学中的假定，它用简洁、准确的语言阐释了计量经济学研究的最新特点。

与传统的教材不同，在陈述和解释假定时，作者完全放弃了非随机的活在重复样本中加以固定的回归元假定。

这种方法更便于读者对计量经济学的理解和应用，是对传统计量经济学教学和研究的一个突破。

本书的主要特点是：（1）不需要具备高深的数学知识，读者只要掌握大学所学的线性代数和概率统计基础知识即可。

（2）强调计量经济学在实际问题中的应用。

（3）含有大量例题，许多是取自或受启发于应用经济学或其他领域的最新及有影响的作品。

本书适合各高等院校经济管理类专业本科生作为计量经济学教材，还可供经济管理类教师及科研人员作为参考书使用。

<<计量经济学导论>>

作者简介

杰弗里·M·伍德里奇，密歇根州立大学经济学特聘教授，1991年以来一直在该校任教。1986—1991年，伍德里奇博士曾担任麻省理工学院的经济学助理教授。他于1982年在加州大学伯克利分校获得计算机科学与经济学学士学位，并于1986年在加州大学圣迭戈分校获得经济学博士学位。

<<计量经济学导论>>

书籍目录

第1篇 横截面数据的回归分析 第1章 计量经济学的性质与经济数据 1.1 什么是计量经济学? 1.2 经验经济分析的步骤 1.3 经济数据的结构 1.4 计量经济分析中的因果关系和其他条件不变的概念 小结 关键术语 习题 计算机习题 第2章 简单回归模型 第3章 多元回归分析:估计 第4章 多元回归分析:推断 第5章 多元回归分析:OLS的渐近性 第6章 多元回归分析:深入专题 第7章 含有定性信息的多元回归分析:二值(或虚拟)变量 第8章 异方差性 第9章 模型设定和数据问题的深入探讨第2篇 时间序列数据的回归分析 第10章 时间序列数据的基本回归分析 第11章 OLS用于时间序列数据的其他问题 第12章 时间序列回归中的序列相关和异方差第3篇 高深专题讨论 第13章 跨时横截面的混合:简单面板数据方法 第14章 高深的面板数据方法 第15章 工具变量估计与两阶段最小二乘法 第16章 联立方程模型 第17章 限值因变量模型和样本选择纠正 第18章 时间序列高深专题 第19章 一个经验项目的实施附录A 基本数学工具附录B 概率论基础附录C 数理统计基础附录D 矩阵代数概述附录E 矩阵形式的线性回归模型附录F 各章问题解答附录G 统计用表

<<计量经济学导论>>

章节摘录

插图：通货膨胀率和国内生产总值等重要宏观经济变量的预测。

尽管对经济指标的预测随处可见而又广为流传，但计量经济方法也可用于那些与宏观经济预测无关的经济领域。

比如，我们可以研究政治竞选支出对投票结果的影响，还可以考虑教育领域学校支出对学生成绩的影响。

此外，我们还将了解如何使用计量方法来预测经济时间序列。

由于计量经济学主要考虑在搜集和分析非实验经济数据时的固有问题，计量经济学已从数理统计分离出来并演化成一门独立学科。

非实验数据并非从对个人、企业或经济系统中的某些部分的控制实验而得来。

[非实验数据有时被称为观测数据或回顾数据，以强调研究者只是被动的数据搜集者这一事实。

]自然科学中的实验数据通常是在实验环境中获得的，但在社会科学中要得到这些实验数据则困难得多。

虽然也可以设计一些社会实验，但为解决经济问题所需要实施的各种控制实验，要么行不通，要么代价高昂而让人望而却步，要么在道德上让人极为反感。

在1.4节我们给出一些特殊的例子，来说明实验数据与非实验数据之间的区别。

当然，只要有可能，计量经济学家总会借用数理统计学家的一些方法。

多元回归分析方法虽然在上述两个领域都是主要支柱，但其着眼点和解释可以极为不同。

此外，经济学家已想出许多新方法，来处理经济数据的复杂性和检验经济理论所预测的结果。

计量经济方法几乎在应用经济学的每一个分支中都相当重要。

要么在我们有一个经济理论需要检验的时候，要么在我们的脑海中有一种关系，而在这一关系对商业决策或政策分析又相当重要的时候，我们便开始使用计量方法。

经验分析就是利用数据来检验某个理论或估计某种关系。

应该如何构建一个经验经济分析呢？

虽然看上去十分明显，但仍值得强调，任何一个经验分析的第一步，都是对所关心问题的详细阐述。

问题可能涉及到对一个经济理论某特定方面的检验，或者对政府政策效果的检验。

原则上，计量经济方法可用来回答诸多方面的问题。

<<计量经济学导论>>

后记

近年来，计量经济学在中国的教学和科研领域都取得重大进展。

不需要太过高深的经济理论，通过对所研究课题的资料搜集，特别是适当的数据样本，利用计量经济学的分析工具就能相对可靠地进行分析，甚至还能得到一些相当新颖的结论。

国内的专业杂志也十分认同经验分析，相对于空洞的理论和文字上费力地论述，这种“用数据说话”的范式似乎具有更严密的逻辑。

即便英文期刊上发表的文章，近20年来也以经验研究为主，即使理论上有所突破，辅以实证检验也更显完美。

面对计量经济学在中国的快速发展，教材建设则十分落后，国内出版的提纲式教材或一些小册子，不仅学习起来晦涩难懂，更扼杀了学生深入学习和实践演练的应有热情。

2000年前后，中国人民大学出版社和梁晶工作室策划引进英文版计量经济学教材，《计量经济学基础》、《计量经济学导论》和《计量经济分析》，立即成为备受学生欢迎的资料，被很多学校选作教材。

这些教材各有特色，大大丰富了国内经济学和非经济学专业的本科生及研究生学习和使用计量经济学教材的选择余地。

本书2000年初版，在第一版的中文版付印之际，便出版了英文版的第二版，但当时我们了解到2006年将出版第三版，因此先让第一版与国内读者见面，现在便迎来了第四版。

第四版与第一版的主要内容和写作风格相差不大，只是修正了一些错误，精确了一些表述，让数据更加直接可用。

本书最重要的特点是以实际应用研究案例指导学生学习和运用计量经济理论和方法，这一直都是本书十分畅销的根本原因。

当然，作者深厚的研究素养和优秀的教学方法（三次获得MIT年度优秀教师称号），以及作者殚精竭虑地为学生着想，使用大量恰到好处的习题，更使得本书特别适合于初学者。

<<计量经济学导论>>

媒体关注与评论

<<计量经济学导论>>

编辑推荐

《计量经济学导论(第4版)》：原版图书配有丰富的网上教学资源库，包括学生习题解答手册、教师手册、各种格式的数据集等，读者可填写书后的《教辅材料申请表》申请获取以上资源。

<<计量经济学导论>>

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>