

<<高级计量经济学导论>>

图书基本信息

书名：<<高级计量经济学导论>>

13位ISBN编号：9787301151853

10位ISBN编号：7301151853

出版时间：2009-8

出版时间：北京大学出版社

作者：朱建平 等编著

页数：292

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>

## <<高级计量经济学导论>>

### 前言

三十余年来,我国一直在朝着市场化改革方向变革,并且初步建成了社会主义市场经济体制。处在这种大背景下,我国的研究生培养模式也在不断变革,以寻求与市场经济相适应的培养模式。

作为这种改革和探索的一部分,自2004年起,我院按照国际化、规范化和本土化相结合的要求,对研究生培养模式进行了较大幅度的改革。

其中一个重要内容,就是更新和调整了课程体系与教学内容。

在已进行研究生教学改革实践的基础上,我院于2006年6月启动了研究生教材建设计划,以便进一步规范课程体系和内容,进一步提高研究生教学质量。

为此,我院组织了研究生统开课程教材的编撰工作。

第一批开始撰写的是四本教材,即《数理经济学》、《高级计量经济学导论》、《高级宏观经济学》与《高级微观经济学》。

在教材的编写过程中,我们总结和吸收了研究生教学实践中的经验,并通过与国内外学者的学习和交流,参考国内外的相关书籍,以及聘请国外长期担任这些课程教学的专家审阅书稿,从而使这一系列教材成为适合我国国情的现代经济学教材。

这一系列教材不仅适用于厦门大学的经济学研究生,而且也可以作为其他院校研究生的教学或参考用书。

我们希望,这一系列教材能对我院乃至我国的研究生教学质量的提高,起到重要的作用。

## <<高级计量经济学导论>>

### 内容概要

本教材的编写本着“以经济理论为基础，以应用数学为方法，以统计推断为思想，以社会实践为目标”的原则，深入浅出地介绍了计量经济学的理论和方法。

全书分为三部分，第一部分也就是第一章绪论，明确了计量经济学的基本概况，介绍了有关统计学和矩阵代数的基本理论知识；第二部分介绍高级经典计量经济学，包括第二章至第六章的内容，具体有线性回归模型、线性回归模型的扩展及经典假设分析、分布滞后与动态模型、联立方程等；第三部分介绍现代计量经济学方法，包括第七章至第九章的内容，具体有时间序列分析、面板数据分析、离散和限制因变量模型等。

## &lt;&lt;高级计量经济学导论&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 绪论 § 1.1 计量经济学概述 § 1.2 统计基本理论 § 1.3 矩阵代数基本知识 本章思考与练习第2章 线性回归模型 § 2.1 线性模型的参数估计 § 2.2 线性模型的检验 § 2.3 预测 § 2.4 实证分析 本章思考与练习第3章 线性回归模型扩展 § 3.1 非线性模型基础 § 3.2 虚拟变量回归 § 3.3 变量标准化回归 § 3.4 实证分析 本章思考与练习第4章 线性回归经典假设的分析 § 4.1 多重共线性 § 4.2 异方差性 § 4.3 序列相关性 § 4.4 实证分析 本章思考与练习第5章 分布滞后与动态模型 § 5.1 分布滞后模型 § 5.2 无穷分布滞后模型 § 5.3 序列相关动态模型的估计与检验 § 5.4 自回归分布滞后模型 § 5.5 实证分析 本章思考与练习第6章 联立方程模型 § 6.1 联立方程模型的基本概念 § 6.2 识别问题 § 6.3 联立方程模型的估计 § 6.4 实证分析 本章思考与练习第7章 时间序列分析 § 7.1 平稳性、ARIMA模型与向量自回归 § 7.2 单位根、趋势平稳、差分平稳与协整 § 7.3 自回归条件异方差 § 7.4 实证分析 本章思考与练习第8章 面板数据分析 § 8.1 面板数据模型的基本分类 § 8.2 固定效应模型 § 8.3 随机效应模型 § 8.4 实证分析 本章思考与练习第9章 离散和限制因变量模型 § 9.1 二元选择模型 § 9.2 多元选择模型 § 9.3 计数数据模型 § 9.4 限制因变量模型 § 9.5 实证分析 本章思考与练习附录 常用统计表参考文献

## 章节摘录

§1.1 计量经济学概述 1.1.1 计量经济学释义 一、计量经济学发展历史考察 从发展的角度看计量经济学，它既是一部计量经济理论发展史，又是一部应用计量经济发展史。因为计量经济学的发展时刻离不开应用，它在应用中诞生，在应用中成熟、独立，又在应用中不断地扩充自身的方法、内容和领域，从而改变了原有单一学科发展的思路，形成了现代计量经济学的分析思路和方法，充分地体现出了计量经济学旺盛的生命力。

为了进一步审视计量经济学的性质，我们有必要对计量经济学的发展历史进行考察。

计量经济学的发展可分为四个时期：（1）20世纪20年代中至20世纪40年代末，为经典计量经济学的产生与形成阶段；（2）20世纪50年代初至20世纪70年代中，为经典计量经济学的发展阶段；（3）20世纪70年代末至20世纪90年代中，为现代计量经济学的形成阶段；（4）20世纪90年代末至今，为现代计量经济学的发展阶段。

1. 经典计量经济学的产生与形成阶段 在20世纪之前，面对错综复杂的经济现象，经济工作者主要是使用头脑直接对材料进行归纳、综合和推理。

19世纪欧洲主要国家先后进入资本主义社会。

工业化大生产的出现，经济活动规模的不断扩大，需要人们对经济问题做出更精确、深入的分析、解释与判断。

这就为计量经济学的诞生形成了社会基础。

到20世纪初，数学、统计学理论日趋完善为计量经济学的出现奠定了理论基础。

17世纪：Newton—Leibniz提出微积分，19世纪初（1809年）德国数学家Gauss提出最小二乘法，1821年提出正态分布理论。

19世纪末英国统计学家Galton提出“回归”概念。

20世纪20年代Fisher, R. 和Neyman J. D. 分别提出抽样分布和假设检验理论。

至此，数理统计的理论框架基本形成。

这时，人们自然想到要用这些知识解释、分析、研究经济问题，从而诞生了计量经济学。

<<高级计量经济学导论>>

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>