

<<经济计量学>>

图书基本信息

书名：<<经济计量学>>

13位ISBN编号：9787543217669

10位ISBN编号：754321766X

出版时间：1970-1

出版时间：格致出版社

作者：李长风

页数：353

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>

## <<经济计量学>>

### 内容概要

经济计量学的研究和应用发展很快。但《经济计量学（第2版）》再版的定位仍然是为学习经济管理类专业的高等院校本科学生、MBA学生以及从事经济管理的专业工作人员提供一本基础、简明、实用的教程。因此编写体例未做大的变动，内容上则作了较多充实。比如，增补了关于金融风险分析的ARCH模型的有关内容介绍和应用实例。同时，在第二版中，始终贯穿Eviews软件的使用。将软件的使用介绍融于教学内容中，在学习经济计量学基本原理和方法的同时，掌握实际应用的工具和手段，以缩短理论与应用之间的距离，这是《经济计量学（第2版）》的初衷之一，也可能是受读者欢迎的原因之一。

## <<经济计量学>>

### 作者简介

李长风，经济学博士，原上海财经大学统计学系副教授、硕士研究生导师，曾任统计学系副主任。

长期从事经济计量学的教学研究，有多部专著出版和多篇论文发表。

参与承担国家级和上海市科研项目，其中国家社科基金项目《体制转轨时期宏观经济分析和预测方法研究》（第二作者）获1998年国家统计局社科项目一等奖。

曾任上海市静安区统计局局长、上海市统计学会第六届理事。

组织实施区域内国情国力调查，撰写的统计分析报告三次获上海市统计学会一等奖。

现任上海市静安区人力资源和社会保障局党委书记、副局长，区劳动人事争议仲裁院院长。

## &lt;&lt;经济计量学&gt;&gt;

## 书籍目录

第1章 绪论第一节 什么是经济计量学第二节 经济计量学的应用步骤第三节 经济计量模型的特点第四节 随机扰动项 的分布及其产生原因第五节 常用的概率分布第六节 Eviews软件功能简介本章小结思考与练习第2章 一元线性回归模型第一节 回归分析与回归方程第二节 参数的最小二乘估计第三节 最小二乘估计量的性质及分布第四节 随机扰动项方差  $\sigma^2$  的估计第五节 一元线性回归模型的统计检验第六节 预测本章小结思考与练习第3章 多重线性回归模型第一节 模型的矩阵表示和基本假定第二节 参数的最小二乘估计及其性质第三节 残差和随机扰动项方差  $\sigma^2$  的估计第四节 多重线性模型的统计检验第五节 预测第六节 多重线性回归分析计算步骤及主要公式本章小结思考与练习第4章 非线性模型第一节 直接代换法第二节 间接代换法第三节 泰勒级数展开法第四节 案例——非线性模型估计的Eviews实现本章小结思考与练习第5章 异方差第一节 异方差的概念第二节 异方差的后果第三节 异方差的检验第四节 异方差的修正方法第五节 案例——居民储蓄模型估计本章小结思考与练习第6章 自相关第一节 自相关的来源和形式第二节 自相关的后果第三节 自相关的检验和识别第四节 自相关的修正方法第五节 案例——地区商品出口模型估计第六节 广义最小二乘法本章小结思考与练习第7章 多重共线性第一节 多重共线性及其原因第二节 多重共线性的影响后果第三节 多重共线性的检验第四节 多重共线性的修正方法第五节 案例——服装市场需求函数本章小结思考与练习第8章 虚拟变量和随机解释变量第一节 虚拟变量模型第二节 案例——上海市生产总值长期趋势模型第三节 随机解释变量模型本章小结思考与练习第9章 滞后变量第一节 滞后变量模型的基本概念第二节 分布滞后模型的参数估计第三节 滞后变量模型的构造第四节 回归与时间序列组合模型的估计第五节 案例——我国长期货币流通量需求模型第六节 自回归条件异方差模型及其估计第七节 时间滞后效应本章小结思考与练习第10章 联立方程模型第一节 联立方程模型的基本概念第二节 联立方程模型的结构式和简化式第三节 联立性偏误第四节 递归模型本章小结思考与练习第11章 联立方程模型的识别第一节 模型识别的概念第二节 模型识别的阶条件和秩条件本章小结思考与练习第12章 联立方程模型的估计第一节 有限信息法——单一方程估计第二节 完全信息法——系统估计本章小结思考与练习第13章 基本经济函数模型第一节 需求函数和消费函数第二节 生产函数和投资函数本章小结思考与练习第14章 经济计量学的应用第一节 经济结构分析第二节 经济预测第三节 政策评价第四节 案例——联立方程模型的求解与模拟本章小结思考与练习第15章 宏观经济计量模型简介第一节 宏观经济计量模型设计概述第二节 宏观经济计量模型的总体构造第三节 宏观经济计量模型举例本章小结思考与练习附表统计表参考文献

## &lt;&lt;经济计量学&gt;&gt;

## 章节摘录

七十多年来,理论经济计量学取得了长足的进展。

在发展初期的十多年中,主要用于研究微观经济。

如H.舒尔兹在消费理论与市场行为方面的研究;道格拉斯(Douglas)对边际生产力的研究;丁伯根在景气循环方面的研究,都为经济计量学开拓了新领域。

R.费里希以统计学和经济理论为基础来测定需求弹性、边际生产力以及总体经济的稳定性,是一大贡献。

20世纪40年代至70年代经济计量学的重点是研究宏观经济。

经济计量学家致力于经济理论的模型化与数学化的研究。

如哈维尔莫(Hoavelmo)和瓦尔德(Wald)将统计推断应用于经济计量学。

50年代,泰尔(Theil)发表了二阶段最小二乘法。

60年代以后有关分布滞后的新处理方法得以发表。

由于计算机的广泛普及使用,大量复杂的经济计量模型得以建立和应用,促进了经济计量学理论与应用的发展。

最近十几年来,经济计量学在理论方法的研究中有了新的突破,英国学者亨德利(Humdry)提出了协整理论,使经济计量学进入了一个新的理论体系。

我国学者在模型识别理论上也做出了贡献。

现代对策论和贝叶斯理论在经济计量学中的应用,是目前经济计量学研究的一个新课题。

.....

## <<经济计量学>>

### 编辑推荐

什么是经济计量学、经济计量学的应用步骤、经济计量模型的特点、随机扰动项 $e$ 的分布及其产生原因、常用的概率分布、Eviews软件功能简介、本章小结、思考与练习、一元线性回归模型、回归分析与回归方程、参数的最小二乘估计、最小二乘估计量的性质及分布、随机扰动项方差 $\sigma^2$ 的估计、一元线性回归模型的统计检验.....

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>