

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787564203061

10位ISBN编号：7564203064

出版时间：2009-3

出版时间：上海财经大学出版社

作者：程振源 编

页数：247

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>>

前言

世界计量经济学学会于1930年12月29日成立，其会刊《计量经济学》杂志也于1933年正式创刊。该学会的成立及其会刊的创刊是计量经济学发展史上的重要里程碑，标志着计量经济学这一学科的产生，极大地推动了计量经济学的研究与发展。

计量经济学在经济学中的地位日渐突出，其取得的成就令人瞩目。

例如，从1969年诺贝尔经济学奖设立以来，因在计量经济学方面的杰出贡献而获奖的人数在经济学各分支学科中名列前茅。

1969年首届诺贝尔经济学奖获得者就是计量经济学家弗里希。

一、20世纪30~50年代计量经济学的研究 (一) 单方程模型 20世纪30年代，以首届诺贝尔经济学奖得主弗里希为代表的计量经济学家致力于单方程计量经济学模型的研究。

但不久就将研究的重点转向了联立方程模型。

此后，单方程模型就一直未受到计量经济学家们的重视。

只是在20世纪70年代有少数几个学者涉足单方程模型这一领域，如Goldberger。

和Griliches (1977) 等人。

(二) 联立方程模型 20世纪40至50年代，计量经济学家们主要致力于联立方程模型的研究，Haavelmo (1944) 开创了该领域研究的先河。

不久，Anderson和Rubin提出了联立方程模型的有限信息极大似然估计法(LIML)，但过于繁琐。

于是，Theil (1956) 提出了两阶段最小平方法(2SLS)。

与有限信息极大似然估计法相比，两阶段最小平方法具有更稳定的性质，并且该方法计算简便，因此很快得到推广。

<<计量经济学>>

内容概要

计量经济学是经济学专业三大核心课程之一，也是一门实践性很强的课程。

学好计量经济学不但要求掌握理论，更为重要的是要能运用它解决实际问题。

计量经济学建模涉及到大量的计算，用手工计算几乎是不可能完成的。

计量经济学软件的出现将经济学家从繁重的计算中解放出来。

目前的计量经济学软件五花八门，种类繁多，我们不可能全部掌握，本书旨在介绍其中最为流行的EViews，内容涵盖了经典和现代计量经济学的大部分内容，其中理论部分作为铺垫，只作简要介绍，重点是通过具体的案例，介绍如何运用EViews建立和检验计量经济学模型。

<<计量经济学>>

书籍目录

代序 计量经济学：历史回顾与未来展望第一章 EViews简介第二章 经典一元线性回归模型第一节 经典一元线性回归理论第二节 经典一元线性回归实验第三章 经典多元线性回归模型第一节 经典多元线性回归理论第二节 经典多元线性回归实验第四章 约束回归与模型结构的稳定性第一节 约束回归第二节 模型结构的稳定性第五章 异方差第一节 异方差理论第二节 异方差实验第六章 多重共线性第一节 多重共线性理论第二节 多重共线性实验第七章 序列相关第一节 序列相关的基本理论第二节 序列相关实验第八章 ARMA模型第一节 ARMA模型概述第二节 随机时间序列的特性分析第三节 ARMA模型的识别与建立第四节 ARMA模型实验第九章 序列的平稳性及其检验第一节 序列的平稳性理论第二节 平稳性检验实验第十章 协整与误差修正模型第一节 协整的理论第二节 协整实验第三节 误差修正模型理论与实验第十一章 自回归条件异方差模型第一节 自回归条件异方差模型的基本理论第二节 常用ARCH模型的实验第十二章 分布滞后模型第一节 分布滞后模型理论第二节 分布滞后模型实验第十三章 二元选择模型第一节 二元选择模型的基本理论第二节 二元选择模型的实验第十四章 联立方程模型第一节 联立方程模型理论第二节 联立方程模型实验第十五章 面板数据模型第一节 面板数据模型理论第二节 面板数据模型实验参考文献后记

章节摘录

第一章 EViews简介 EViews : Econometric Views (经济计量视图), 是美国QMS公司 (Quantitative Micro Software Co. , 网址为<http://www.EViews.com>) 开发的运行于Windows环境下的经济计量分析软件。

EViews是在大型计算机的TSP (TimeSeries Processor) 软件包基础上发展起来的新版本, 是一组处理时间序列数据的有效工具, 1981年QMS (Quantitative Micro Software) 公司在Micro TSP基础上直接开发成功EViews并投入使用。

虽然EViews是由经济学家开发的并大多在经济领域应用, 但它的适用范围不应只局限于经济领域。EViews得益于Windows的可视的特点, 能通过标准的Windows菜单和对话框, 用鼠标选择操作, 并且能通过标准的Windows技术来使用显示于窗口中的结果。

此外, 还可以利用EViews强大的命令功能和大量的程序处理语言进入命令窗口修改命令, 也可以将计算工作的一系列操作建立成相应的计算程序并存储, 可以通过直接运行程序来完成工作。

EViews是应用较为广泛的经济计量分析软件——MicroTSP的Windows版本, 它引入了全新的面向对象概念, 通过操作对象实现各种计量分析功能。

EViews软件功能很强, 能够处理以时间序列为主的多种类型数据, 进行包括描述统计、回归分析、传统时间序列分析等基本数据分析以及建立条件异方差、向量自回归等复杂的计量经济模型。

.....

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>