第一图书网, tushu007.com

<<经济计量学精要>>

图书基本信息

书名：<<经济计量学精要>>

13位ISBN编号：9787111313366

10位ISBN编号：7111313364

出版时间：2010-8

出版时间：机械工业出版社

作者：（美）古扎拉蒂，（美）波插　著，张涛　译注

页数：543

译者：张涛 注释

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

与前几版一样，《经济计量学精要》第4版最主要的目的是向读者通俗易懂地介绍经济计量学的理论和技术。
本书主要面向经济学和工商管理专业的本科生以及MBA学员，也适用于涉及经济计量分析，尤其是回归分析的其他社会科学和行为科学专业的学生。
本书力求通过大量的实例、翔实的解释和丰富的习题帮助学生理解经济计量技术。
虽然我已年过80，但是对于经济计量学的热爱丝毫未减，并努力跟踪这个领域的最新进展。
我的助手，南加州大学洛杉矶分校马歇尔商学院统计学助理教授道恩博士（也是本书的作者之一）给了我极大的支持与帮助。
本书第4版凝结了我们的坚持与付出。
本版特点在介绍本书内容变更之前，首先提醒读者关注本版的一些特点：（1）为了直接进入线性回归这个核心内容，本版把统计学基础知识放在了附录部分，这样可以随时翻阅附录回顾统计学知识。
（2）本版案例中的数据都进行了更新。
（3）本版增加了一些新例子。
（4）在某些章节还对原版的例子进行了扩展。
（5）本版还给出了一些例子的计算机输出结果。
本多数例子都是基于EViews6、STATA和MINITAB实现的。
（6）本版还提供了一些新图像。
（7）本版引入了新的数据集。
（8）为了简约版面，本版仅罗列出一些小样本数据，大样本数据在网上教材日中给出。
当然，网上教材提供了书中使用到的所有数据。

第一图书网, tushu007.com

内容概要

本书旨在向读者介绍经济计量理论和技术，力求通过大量的实例、翔实的解释和丰富的习题帮助学生理解经济计量技术。
根据学生和教师的建议，第4版的框架进行了重新调整，增加了许多新例子，并恰如其分地给出了各种软件的计算机输出结果。
　本书重点面向经济学和管理类专业本科生以及MBA学员，也适用于涉及经济计量分析，尤其是回归分析的其他社会科学和行为科学专业的学生。

作者简介

达莫达尔N．古扎拉蒂，曾执教于纽约城市大学(25年多)和西点军事学院社会科学系 (17年)。
古扎拉蒂博士于1960年获孟买大学商学硕士学位，1963年获芝加哥大学MBA硕士学位，1965年获芝加哥大学博士学位。
古扎拉蒂曾在Review of Economics and Statistics，Economic．Journal，Jou

书籍目录

出版说明前言作者简介教学建议 第1章 经济计量学的特征及研究范围 1.1 什么是经济计量学 1.2 为什么要学习经济计量学 1.3 经济计量学方法论 1.4 全书结构 关键术语和概念 问题 习题 附录1A 互联网上的经济数据第一部分 线性回归模型 第2章 线性回归的基本思想：双变量模型 2.1 回归的含义 2.2 总体回归函数(PRF)：假想一例 2.3 总体回归函数的统计或随机设定 2.4 随机误差项的性质 2.5 样本回归函数 2.6 “线性”回归的特殊含义 2.7 从双变量回归到多元线性回归 2.8 参数估计：普通最小二乘法 2.9 综合 2.10 一些例子 2.11 小结 关键术语和概念 问题 习题 选作题 附录2A 最小二乘估计值的推导 第3章 双变量模型：假设检验 3.1 古典线性回归模型 3.2 普通最小二乘法估计量的方差与标准误 3.3 为什么使用OLS?OLS估计量的性质 3.4 OLS估计量的抽样分布或概率分布 3.5 假设检验 3.6 拟合回归直线的优度：判定系数γ2 3.7 回归分析结果的报告 3.8 数学S.A.T一例的计算机输出结果 3.9 正态性检验 3.10 综合实例：美国商业部门工资和生产率的关系(1959～2006年) 3.11 预测 3.12 小结 关键术语和概念 问题 习题 第4章 多元回归：估计与假设检验 4.1 三变量线性回归模型 4.2 多元线性回归模型的若干假定 4.3 多元回归参数的估计 4.4 估计多元回归的拟合优度：多元判定系数R2 4.5 古董钟拍卖价格一例 4.6 多元回归的假设检验 4.7 对偏回归系数进行假设检验 4.8 检验联合假设：82=83=0或R2=0 4.9 从多元回归模型到双变量模型：设定误差 4.10 比较两个尺’值：校正的判定系数 4.11 什么时候增加新的解释变量 4.12 受限最小二乘法 4.13 若干实例 4.14 小结 关键术语和概念 问题 习题 附录4A.1 式(4-20)至(4-22)中 OLS估计量的推导 附录4A.2 式{4-31)的推导 附录4A.3 式(4-50)的推导 附录4A.4 古董钟拍卖价格一例的EViews输出结果 第5章 回归模型的函数形式 5.1 如何度量弹性：双对数模型 5.2 比较线性和双对数回归模型 5.3 多元对数线性回归模型 5.4 如何预测增长率：半对数模型 5.5 线性一对数模型：解释变量是对数形式 5.6 倒数模型 5.7 多项式回归模型 5.8 过原点的回归 5.9 关于度量比例和单位的说明 5.10 标准化变量的回归 5.11 函数形式小结 5.12 小结 关键术语和概念 问题 习题 附录5A 对数 第6章 虚拟变量回归模型 6.1 虚拟变量的性质 6.2 ANCOVA模型：包含一个定量变量、一个两分定性变量的回归 6.3 包含一个定量变量、一个多分定性变量的回归 6.4 包含一个定量变量和多个定性变量的回归 6.5 比较两个回归 6.6 虚拟变量在季节分析中的应用 6.7 应变量也是虚拟变量的情形：线性概率模型(LPM) 6.8 小结 关键术语和概念 问题 习题第二部分 实践中的回归分析 第7章 模型选择：标准与检验 7.1 “好的”模型具有的性质 7.2 设定误差的类型 7.3 遗漏相关变量：“过低拟合”模型 7.4 包括不相关变量：“过度拟合”模型 7.5 不正确的函数形式 7.6 度量误差 7.7 诊断设定误差：设定误差的检验 7.8 小结 关键术语和概念 问题 习题 第8章 多重共线性：解释变量相关会有什么后果 8.1 多重共线性的性质：完全多重共线性的情形 8.2 近似或者不完全多重共线性的情形 8.3 多重共线性的理论后果 8.4 多重共线性的实际后果 8.5 多重共线性的诊断 8.6 多重共线性必定不好吗 8.7 扩展一例：1960～1982年期间美国的鸡肉需求 8.8 如何解决多重共线性：补救措施 8.9 小结 关键术语和概念 问题 习题 第9章 异方差：如果误差方差不是 常数会有什么结果 9.1 异方差的性质 9.2 异方差的后果 9.3 异方差的诊断：如何知道存在异方差问题 9.4 观察到异方差该怎么办：补救措施 9.5 怀特异方差校正后的标准误和τ统计量 9.6 若干异方差实例 9.7 小结 关键术语和概念 问题 习题 第10章 自相关：如果误差项相关会有什么结果 10.1 自相关的性质 10.2 自相关的后果 10.3 自相关的诊断 10.4 补救措施 10.5 如何估计p 10.6 校正OLS标准误的大样本方法：纽维-韦斯特(Newey-West)方法 10.7 小结 关键术语和概念 问题 习题 附录10A 游程检验 附录10B 自相关的一般性检验：布鲁尔什-戈弗雷(BG)检验第三部分 经济计量学高级专题 第11章 联立方程模型 11.1 联立方程模型的性质 11.2 联立方程的偏误：OLS估计量的非一致性 11.3 间接最小二乘法 11.4 间接最小二乘法：一则实例 11.5 模型识别问题 11.6 识别规则：识别的阶条件 11.7 过度识别方程的估计：两阶段最小二乘法 11.8 2SLS：一个数字例子 11.9 小结 关键术语和概念 问题 习题 附录11 AOLS估计量的非一致性 第12章 单方程回归模型的几个专题 12.1 动态经济模型：自回归和分布滞后模型 12.2 伪回归现象：非平衡时间序列 12.3 平稳性检验 12.4 协整时间序列 12.5 随机游走模型 12.6 分对数模型 12.7 小结 关键术语和概念 问题 习题 附录 概率论与统计学基础附录A 统计学回顾：概率与概率分布附录B 概率分布的特征附录C 一些重要的概率分布附录D 统计推断：估计与假设

第一图书网, tushu007.com

检验附录E 统计表附录F EViews、MONITAB、Excel和STATA的计算机输出结果参考文献

章节摘录

插图：It is very important to bear in mind the warning given in Chapter 1 that, although regression analysis deals with the relationship between a dependent variable and one or more independent variables, it does not necessarily imply causation; that is, it does not necessarily mean that the independent variables are the cause and the dependent variable is the effect. If causality between the two exists, it must be justified on the basis of some (economic) theory. As noted earlier, the law of demand suggests that if all other variables are held constant, the quantity demanded of a commodity is (inversely) dependent on its own price. Here microeconomic theory suggests that the price may be the causal force and the quantity demanded the effect. Always keep in mind that regression does not necessarily imply causation. Causality must be justified, or inferred, from the theory that underlies the phenomenon that is tested empirically.Regression analysis may have one of the following objectives:1. To estimate the mean, or average, value of the dependent variable, given the values of the independent variables.2. To test hypotheses about the nature of the dependence——hypotheses sug- gested by the underlying economic theory. For example, in the demand function mentioned previously, we may want to test the hypothesis that the price elasticity of demand is, say, -1.0; that is, the demand curve has unitary price elasticity. If the price of the commodity goes up by 1 per- cent, the quantity demanded on the average goes down by 1 percent, assuming all other factors affecting demand are held constant.

媒体关注与评论

古扎拉蒂博士的《经济计量学精要》既介绍了经典的计量经济基础知识，又着眼于计量经济学科的发展前沿，内容完整、丰富，是一部关于经济计量学基础理论的经典著作！

——中国社会科学院数量经济与技术经济研究所所长 汪同三《计量经济学精要》深入浅出，通过大量有趣的经济学实例来阐述计量经济学的基本理论及其应用：更难得的是，通过介绍常用统计软件和提供网上数据资源库，培养学生动手进行数据处理和实证分析的能力，是一本优秀的计量经济学入门读物。

——美国康奈尔大学经济学系终身教授 厦门大学王亚南经济研究院长江学者讲座教授 洪水淼这是一本将计量经济学理论方法与应用融为一体的好教材！

——清华大学经济管理学院教授 李子奈这是一本适于初学者的好教材。在书前先介绍统计推断，很有特色！

——南开大学经济学院教授、数量经济研究所所长 张晓峒

编辑推荐

《经济计量学精要(英文原书第4版)》是高等学校经济管理英文版教材·经济系列之一。

第一图书网, tushu007.com

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