

<<高级计量经济学（上册）>>

图书基本信息

书名：<<高级计量经济学（上册）>>

13位ISBN编号：9787301112793

10位ISBN编号：7301112793

出版时间：2007-8

出版时间：北京大学出版社

作者：靳云汇,金赛男

页数：466

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（上册）>>

### 内容概要

本书详细介绍了计量经济学的理论与方法，包括经典的模型、传统的估计和检验方法，也包括现代一些重要的成果。

本书不仅介绍了建模的技术和方法，而且阐述了其理论背景。

为便于读者学习和理解，本书在相关各章中给出了范例，并结合例题介绍了专用软件。

本书适合做高等院校经济学、管理学的研究生教材，也适合做从事定量研究的经济、管理人员的参考书。

本书习题中的数据可以免费提供给任课教师使用。

如需要，欢迎填写书后的“教师反馈及课件申请表”索取。

<<高级计量经济学（上册）>>

作者简介

靳云汇，1939年生，1962年毕业于北京大学数学力学系计算数学专业（六年制）。1960-1978年在北京大学数学力学系任教，1979年至今在北京大学经济系、经济学院、光华管理学院任讲师、副教授、教授、博士生导师，主要从事计量经济学的教学与研究。

## &lt;&lt;高级计量经济学(上册)&gt;&gt;

## 书籍目录

第一章 计量经济学介绍 1 计量经济模型的建立 2 计量经济模型 3 计量经济学简介 第二章 多元线性回归模型设定 1 总体回归模型的数学形式 2 古典线性回归模型的基本假定 3 特例：一元、二元线性回归模型 第三章 多元线性回归模型估计 1 总体参数 $\beta$ 的普通最小二乘估计 2  $\beta$ 的普通最小二乘估计量的统计特性 3 离差形式 4 参数子集估计 5  $\sigma^2$ 的普通最小二乘估计 6 最大似然估计 7 无截距回归模型的参数估计 8 范例 第四章 多元线性回归模型检验 1 拟合优度 2 统计推断 3 范例 第五章 多元线性回归模型的应用：预测 1 预测假定 2 均值预测 3 个别值预测 4 一片时点预测 5 预测精度度量 6 范例 第六章 线性回归模型初步扩展 1 函数形式 2 虚拟变量 第七章 一般线性假设检验及其应用 1 线性约束估计 2 一般线性假设检验 3 结构变化检验 4 模型稳定性检验 5 格兰杰因果关系检验 第八章 渐近理论 1 基本概念 2 估计量的统计特性 3 最大似然估计量及其大样本特性 4 参数约束检验 5 关于随机扰动项正态性的讨论 第九章 多重共线性 1 多重共线性的含义 2 多重共线性的影响 3 多重共线性的诊断 4 建议疗法 5 主分量法 第十章 非球形扰动项 1 非球形扰动项的含义 2 普通最小二乘估计 3 广义最小二乘估计 4 最大似然估计 第十一章 异方差性 1 异方差的概念 2 普通最小二乘估计 3 异方差性的检验 4 广义最小二乘估计 5 最大似然估计 第十二章 自相关性 1 基本概念 2 自相关的类型 3 普通最小二乘估计 4 自相关性的检验 5  $n$ 已知情况下的估计 6  $n$ 未知情况下的估计 7 自相关下的预测 8 自回归条件异方差 第十三章 内生解释变量与工具变量法 1 内生解释变量及其影响 2 工具变量法 第十四章 模型设定分析 1 设定误差分析 2 设定误差检验 3 设定检验 4 解释变量的选择 附录 统计学用表 参考书目 建模练习题 中英文术语对照

<<高级计量经济学（上册）>>

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>