第一图书网, tushu007.com

# <<计量经济学教程>>

## 图书基本信息

书名：<<计量经济学教程>>

13位ISBN编号：9787309042238

10位ISBN编号：7309042239

出版时间：2004-12

出版时间：复旦大学出版社

作者：谢识予

页数：282

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

## 内容概要

本教材是为经济和管理类专业大学生编写的计量经济学入门教材，目标是通过对计量经济分析基本思想、概念和模型的介绍，让学生掌握计量经济分析的基本原理和一定的应用能力，并打好进一步学习计量经济学高深专题的基础。

根据本教材的定位目标，作者努力避免使用过多数学语言和推导，控制对读者数学基础的要求，完全没有使用矩阵代数，而且在介绍计量经济分析方法之前先介绍概率统计的准备知识。

此外，考虑到计量经济分析广泛应用计量软件的实际情况和读者的需要，本教材在计量经济建模、参数估计和预测分析等方面加强了计量软件（EViews）的应用，淡化了对计算方法、技巧的介绍和要求。

本教材深入浅出，结构紧凑，适合作为经济和管理类专业一学期课程的基本教材，也适合其他计量经济学初学者自学。

限于作者的水平，本教材难免存在各种缺点错误。

恳请读者不吝赐教，以利改进。

## 作者简介

谢识予，男，1962年生。
现为复旦大学世界经济系教授、数量经济学专业博士生导师，全国经济对策论研究会（中国数量经济学会经济对策论分会）副理事长，中国数量经济学会高校委员会委员，复旦大学经济学博士。
主要教学和研究领域包括博弈论、计量经济学、经济增长理论和经济数学方法等。
近年来发表论文数十篇，出版专著和教材多部。
获得全国普通高等学校优秀教材奖、上海市优秀教学成果奖、上海市哲学社会科学优秀成果奖等多项教学科研奖励。

## 书籍目录

第一章 导论第一节 计量经济学的产生和发展第二节 计量经济学的功能和作用第三节 计量经济学的分析方法第四节 计量经济模型第五节 经济数据和计量经济分析本章小结思考练习题第二章 概率统计基础第一节 随机性与概率第二节 随机变量和概率分布第三节 参数估计和假设检验本章小结思考练习题第三章 两变量线性回归第一节 两变量线性回归模型第二节 参数估计第三节 最小二乘估计量的性质第四节 回归拟合度评价和决定系数第五节 统计推断第六节 预测本章小结思考练习题第四章 多元线性回归分析第一节 多元线性回归模型第二节 参数估计第三节 回归拟合度评价和决定系数第四节 统计推断和预测本章小结思考练习题第五章 线性回归的定式偏差第一节 变量关系非线性第二节 异常值第三节 规律性扰动第四节 解释变量缺落第五节 参数变化本章小结思考练习题第六章 异方差第一节 异方差及其影响第二节 异方差的发现和判断第三节 异方差的克服和处理本章小结思考练习题第七章 误差序列相关第一节 误差序列相关的性质和原因第二节 误差序列相关的发现和判断第三节 误差序列相关的克服和处理本章小结思考练习题第八章 多重共线性第一节 多重共线性及其影响第二节 多重共线性的发现和检验第三节 多重共线性的克服和处理本章小结思考练习题第九章 分布滞后和自回归模型第一节 分布滞后模型第二节 自回归模型第三节 因果关系检验本章小结思考练习题第十章 伪回归和单位根第一节 时间序列及其平稳性第二节 时间序列平稳性检验第三节 时间序列的单积和协积本章小结思考练习题第十一章 联立方程组模型第一节 联立方程组模型及其假设第二节 联立方程组模型的识别性第三节 联立方程组模型的参数估计本章小结思考练习题第十二章 计量经济分析建模和应用第一节 建模技术和模型选择第二节 建模示例第三节 分析步骤和计量软件的运用本章小结思考练习题附录 统计表参考文献

## 章节摘录

一、经济变量经济模型的基础是经济变量，因此先从经济变量谈起。
经济变量是国民经济各方面活动水平或状态的测度。
由于国民经济有许多方面，对国民经济各方面的考察又有多种角度，而且经济运行受到多方面因素的影响，因此在经济研究，特别是计量经济学的实证研究中，涉及的经济变量有许多种类。
经济变量的选择和运用是否得当，对计量经济分析的有效性有很大影响，因此对经济变量的种类和各自在计量分析中的特点有一定了解，对更好地选择和运用各种经济变量，提高计量经济分析的有效性和价值是有意义的。
1．经济变量的统计类型(1)宏观经济变量和微观经济变量。
根据测度对象，经济变量首先可以分为宏观经济变量和微观经济变量。
前者指反映国民经济总体活动水平的总量指标，如国内生产总值、国民收入、人口数等；而后者则是反映国民经济中个体(个人、企业等)经济活动水平的量值，如个人或家庭的收入、消费，厂商的产量、销量和利润等。
宏观变量和微观变量之间也是有联系的，因为总量是个量的某种形式的加总，总量的规律与个量的规律之间必然有内在联系。
宏观变量和微观变量分别用于宏观计量经济分析和微观计量经济分析中，但有时也会利用它们之间的联系，结合运用这两种变量。
对于学习过宏观经济学和微观经济学的读者来说，宏观和微观经济变量的概念、区别和联系是早已熟知的。
(2)流量和存量。
经济变量还可以分为流量和存量。
例如，每年的投资额是流量，而固定资产总额则是存量；收入是流量，而财产则是存量。
流量和存量之间可以有密切关系和相互转化。
例如，投资是流量，资产是存量，但投资的累加扣除折旧就是资产总额，某年的资产总额净增量加上该年的折旧就是当年的投资。
在计量经济分析中，流量和存量都是有用的变量。

## 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