

<<计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<计量经济学>>

13位ISBN编号：9787543218109

10位ISBN编号：7543218100

出版时间：2010-8

出版时间：格致出版社

作者：沈根祥

页数：188

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>>

### 内容概要

《计量经济学》是一本通俗易懂的本科教材，介绍了计量经济学的基本定义，方法和建模应用，同时配有EVIENS软件操作，是一部实用性很强的教材。

## <<计量经济学>>

### 作者简介

沈根祥，上海财经大学经济学院教授，博士生导师，上海数量经济学会理事。研究领域为计量经济学理论和方法、金融计量经济学、金融市场数量分析，在《数量经济技术经济研究》、《中国管理科学》、《财经研究》、《世界经济》等期刊发表论文多篇。

## &lt;&lt;计量经济学&gt;&gt;

## 书籍目录

1 经济数据与计量经济学1.1 经济数据1.2 计量经济学的实质1.3 数据资源和软件习题2 概率论与统计学复习2.1 概率论2.2 统计学习题附录2.1 广义矩方法附录2.2 极大似然估计的性质3 回归分析的基本概念和方法——元线性回归模型3.1 一元线性回归模型的设定3.2 一元线性回归模型的参数估计3.3 基本假设下OLS估计的统计性质3.4 误差方差估计3.5 回归系数和误差方差的区间估计3.6 回归系数检验(t检验)3.7 拟合优度 $R^2$ 和模型检验(F检验)3.8 用Eviews进行一元线性回归习题附录3.1 回归模型参数的矩估计法附录3.2 回归模型参数的极大似然估计4 多元线性回归模型4.1 多元线性回归模型的设定4.2 多元线性回归模型的参数估计4.3 多元线性回归模型的矩阵表示4.4 回归系数OLS估计的性质4.5 误差方差估计4.6 回归系数检验(t检验)4.7 回归拟合优度 $R^2$ 和调整 $R^2$ ( $R^2$ )4.8 模型选择的其他标准——信息准则4.9 回归模型检验(F检验)4.10 用Eviews进行多元线性回归习题附录4.1 OLS估计性质证明附录4.2 回归模型OLS估计的几何解释附录4.3 带常数项和不带常数项回归模型OLS估计的性质5 线性回归模型的应用5.1 多元回归分析与因素控制5.2 模型中变量的形式5.3 虚拟变量5.4 参数约束检验习题附录5.1 (5.5)式的证明附录5.2 简单相关系数和偏相关系数之间的关系证明附录5.3 用两次回归估计回归系数附录5.4 虚拟变量中的问题：对照样本比例失衡对参数估计的影响6 异方差、自相关和多重共线性6.1 异方差6.2 序列相关6.3 多重共线性习题附录6.1 广义最小二乘法附录6.2 异方差-自相关一致的协方差矩阵估计附录6.3 极大似然比检验和拉格朗日检验附录6.4 多重共线性的诊断和处理7 内生性和工具变量估计方法7.1 内生性7.2 工具变量估计方法7.3 内生性检验习题附录7.1 工具变量估计和TSLS估计的等价性证明附录7.2 弱工具变量问题8 分类选择模型8.1 二元选择模型8.2 有序选择模型习题附录8.1 Probit模型极大似然估计的渐进分布附录8.2 离散选择模型的异方差检验附录8.3 二元选择模型的设定检验9 平稳时间序列分析9.1 时间序列的有关概念9.2 时间序列的类型9.3 自回归模型的相关结构9.4 自回归模型的识别和估计9.5 自回归分布滞后模型和格兰杰因果关系检验9.6 条件异方差动态模型：ARCH模型和GARCH模型习题附录9.1 平稳时间序列的大数定律附录9.2 平稳时间序列的中心极限定理10 非平稳时间序列分析10.1 随机游动和单位根10.2 时间序列的趋势和去势10.3 单位根检验10.4 单整序列和ARIMA模型10.5 协整与误差修正模型习题附录10.1 从随机游动到布朗运动附录10.2 (10.7)式的推导附录10.3 DF检验统计量分布的推导附录A：统计分布表附表1：标准正态分布概率表附表2： $\chi^2$ 分布临界值表附表3：t分布双侧临界值表附表4：F分布临界值表一： $\alpha=0.01$ 附表4：F分布临界值表二： $\alpha=0.05$ 附表5：Dw检验临界值表( $\alpha=0.05$ )附表6(一)：单位根检验中F检验临界值表a附表6(二)：单位根检验中F检验临界值表b附表6(三)：协整检验回归残差单位根ADF检验临界值表附录B：Eviews6.0简介B.1：工作文件的建立B.2：生成新变量B.3：Eviews数据处理B.4：Eviews应用举例——多元线性回归分析参考文献习题选解

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>