

<<中级计量经济学>>

图书基本信息

书名：<<中级计量经济学>>

13位ISBN编号：9787811389517

10位ISBN编号：7811389517

出版时间：2010-10

出版时间：西南财经大学出版社

作者：张卫东 编

页数：213

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>

<<中级计量经济学>>

内容概要

计量经济学是现代经济学和管理学的重要组成部分，自其诞生以来取得了飞速的发展，产生了众多重要的理论与应用成果。

在我国，尽管只有短短三十年的历史，计量经济学的理论研究和实际应用已为许多人所重视，其作用也日益突出。

计量经济学课程也成为高等院校经济管理类专业本科生和研究生的核心课程。

正是在这样的背景下，本着“重思想，重方法，重应用”的原则，我们编写了这本经济管理类专业硕士研究生的教材。

《中级计量经济学》在回顾计量经济学经典方法的基础上，重点讲授20世纪70年代以后出现的新方法，同时辅以计算机实践等内容。

通过本课程的学习，要求学生能够掌握计量经济分析中基本方法的原理（包括背景与思想）和运用操作，训练、提高计量经济思维与分析问题的能力。

一方面，学生要能够运用所学方法对实际经济问题进行判断与分析；另一方面，在此基础上学生要能够继续学习计量经济学中的进一步问题。

在学习本课程之前，要求学生已经学习过线性代数、概率论与数理统计、计量经济学（初级）。

<<中级计量经济学>>

书籍目录

第一章 导论第一节 计量经济学的作用和意义第二节 经典计量经济学概述第三节 非经典计量经济学概述
第二章 线性回归模型回顾与拓展第一节 古典假定的再认识第二节 线性回归模型估计方法及拓展
第三节 线性回归模型的检验方法及拓展第三章 放宽基本假定及其拓展第一节 异方差、自相关的再认识
第二节 多重共线性再认识第三节 外生性假定的违背——内生性问题第四章 设定误差第一节
设定误差概述第二节 设定误差的后果第三节 设定误差的检验第五章 离散选择模型第一节 线性概率
模型第二节 Logit模型第三节 Probit模型第六章 平稳时间序列模型第一节 基本概念第二节 移动平均
(MA)过程第三节 自回归(AR)过程第四节 自回归移动平均过程ARMA(p, q)第七章 非平稳时
间序列第一节 伪回归问题第二节 单位根过程与检验第三节 协整分析第八章 向量自回归模型第一节 平
稳的VAR过程第二节 非限制性向量自回归模型的估计第三节 VAR模型的应用第四节 协整与误差校正
模型第九章 自回归条件异方差过程初步第一节 ARCH过程第二节 衍生GARCH模型第三节 在Eviews中
估计GARCH(p, q)模型第十章 面板数据模型初步第一节 面板数据模型分类第二节 固定效应模型第
三节 随机效应模型第四节 面板数据模型设定检验方法第五节 案例分析参考文献

<<中级计量经济学>>

章节摘录

当然它们也有不同之处。

作为社会科学的经济学，研究的问题是具有意识和理智的人们的经济行为，并且，社会经济现象的规律性主要是在千百万人的活动之中，而不是表现在个别人的行动中。

因此，经济学不能完全靠在实验室里做实验来构造以及检验经济学理论。

我们应该认识到社会经济现象的客观复杂性和经济学实证方法论的局限性。

经济学按研究的范式不同分为规范经济学（研究经济学中所涉及的道德规范、价值判断问题，力求说明“应该是什么”的问题）与实证经济学（在做出一定行为关系的假设下，分析与预测行为的经济后果，力求说明“是什么”的问题）。

计量经济学是典型的实证经济学，它没有自己的经济理论，而是分析方法的应用和创新。

在经济分析中引入数学和统计方法，是因为数学或统计方法具有很强的逻辑性、客观性、通用性和独立性。

这也正体现了计量经济学作为典型的数量分析工具的作用和意义。

……

<<中级计量经济学>>

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>