

《计量经济学》

图书基本信息

书名：《计量经济学》

13位ISBN编号：9787040289619

10位ISBN编号：704028961X

出版时间：2010-3

出版社：高等教育出版社

作者：李子奈,潘文卿

页数：363

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu111.com

《计量经济学》

内容概要

本书融计量经济学理论、方法与应用为一体：以中级水平内容为主，适当吸收初级和高级水平的内容；以经典线性模型为主，适当介绍一些适用的非经典模型。全书形成了一个独具特色的内容体系。全书详细论述了经典的单方程计量经济学模型的理论方法，适当介绍了联立方程计量经济学模型和时间序列计量经济学模型的理论方法，并引入了几类扩展的单方程计量经济学模型。在计量经济学应用模型中，本书着重讨论了模型类型选择、模型变量选择、模型函数关系设定和模型变量性质设定的原则和方法。在详细介绍线性回归模型的数学过程的基础上，各章的重点不是理论方法的数学推导与证明，而是对实际应用中出现的实际问题的处理，并尽可能与中国的模型实例相结合。本书既包含了由教育部经济学学科教学指导委员会制定的高等学校经济学科本科计量经济学课程教学基本要求的全部内容，又为学有余力者提供了进一步学习的指南。该书适合于作为各类高等院校经济、管理学科本科生的教材或教学参考书，也可供具有一定数学、经济学和经济统计学基础的经济管理人員和研究人员阅读和参考。

《计量经济学》

作者简介

李子奈，清华大学经管学院经济系教授。1970年获清华大学工程物理系学士，1981年获清华大学核能技术研究院硕士。主要讲授课程包括：计量经济学、高等计量经济学。

研究领域包括计量经济学理论、方法与应用，宏观经济模型与政策，“三农”问题。主持过多个国家自然科学基金、社会科学基金、科技部、财政部、教育部、国家开发银行等资助研究项目。在Journal of Econometrics, Frontiers of Economics in China等国际期刊和《中国社会科学》、《经济研究》、《管理世界》、《数量经济技术经济研究》、《经济学动态》、《世界经济》、《统计研究》、《财政研究》等国内期刊发表百余篇学术论文。曾获得国家、北京市、教育部等奖励10余项，其中包括：国家精品课程奖、北京市精品课程奖、高等教育国家级教学成果二等奖、北京市高等教育教学成果一等奖、教育部优秀教材一等奖、北京市高校教学名师奖、宝钢教育基金优秀教师奖等。

目前担任教育部经济学学科教学指导委员会委员、中国数量经济学会副理事长、北京经济学总会副会长。

潘文卿，清华大学经管学院经济系副教授。1999年获中国人民大学经济学博士学位，1992年获兰州大学管理学硕士学位，1987年本科毕业于西北师范大学数学系。之后任教于兰州大学经济系，并于1999-2001年间任职于清华大学经济管理学院博士后工作站，2001年起任教于经济管理学院经济系至今。主要讲授课程包括：经济统计学、计量经济学、高级计量经济学、投入产出分析。

主持多项国家自然科学基金课题。在《中国社会科学》、《经济研究》、《数量经济技术经济研究》、《统计研究》、《系统工程理论与实践》等国内学术期刊上发表论文多篇。

目前担任中国数量经济学会理事以及中国投入产出研究学会副理事长。

书籍目录

绪论

- § 1.1 计量经济学
- § 1.2 建立经典单方程计量经济学模型的步骤和要点
- § 1.3 计量经济学模型的应用

本章练习题

第二章 经典单方程计量经济学模型：一元线性回归模型

- § 2.1 回归分析概述
- § 2.2 一元线性回归模型的基本假设
- § 2.3 一元线性回归模型的参数估计
- § 2.4 一元线性回归模型的统计检验
- § 2.5 一元线性回归分析的应用：预测问题
- § 2.6 实例及时间序列问题

本章练习题

第三章 经典单方程计量经济学模型：多元线性回归模型

- § 3.1 多元线性回归模型
- § 3.2 多元线性回归模型的参数估计
- § 3.3 多元线性回归模型的统计检验
- § 3.4 多元线性回归模型的预测
- § 3.5 可化为线性的多元非线性回归模型
- § 3.6 受约束回归

本章练习题

第四章 经典单方程计量经济学模型：放宽基本假定的模型

- § 4.1 异方差性
- § 4.2 序列相关性
- § 4.3 多重共线性
- § 4.4 随机解释变量问题

本章练习题

第五章 经典单方程计量经济学模型：专门问题

- § 5.1 虚拟变量模型
- § 5.2 滞后变量模型
- * § 5.3 模型设定偏误问题

本章练习题

第六章 联立方程计量经济学模型：理论与方法

- § 6.1 联立方程计量经济学模型的提出
- § 6.2 联立方程计量经济学模型的若干基本概念
- § 6.3 联立方程计量经济学模型的识别
- § 6.4 联立方程计量经济学模型的估计
- § 6.5 联立方程计量经济学模型若干问题的讨论

本章练习题

第七章 扩展的单方程计量经济学模型

- § 7.1 选择性样本计量经济学模型
- § 7.2 二元离散选择模型
- § 7.3 平行数据计量经济学模型

本章练习题

第八章 时间序列计量经济学模型

- § 8.1 时间序列的平稳性及其检验
- § 8.2 随机时间序列分析模型

§ 8.3 协整与误差修正模型

本章练习题

第九章 计量经济学应用模型

§ 9.1 计量经济学应用模型类型设定

§ 9.2 计量经济学应用模型总体回归模型设定

§ 9.3 计量经济学应用模型函数关系设定

§ 9.4 计量经济学应用模型变量性质设定 ”

本章练习题

附录 统计分布表

一、标准正态分布表

二、 χ^2 分布表

四、F分布表

五、D.W.检验上下界表

六、协整检验临界值表

参考文献

章节摘录

版权页：插图：随机误差项 μ 的条件零均值假设意味着 μ 的期望不依赖于 X 的变化而变化，且总为常数零。该假设表明 μ 与 X 不存在任何形式的相关性，因此该假设成立时也往往称 X 为外生解释变量（exogenous explanatory variable），否则称 X 为内生解释变量（endogenous explanatory variable）。该假设最为重要，只有该假设成立时，总体回归函数的随机形式（2.1.7）式才能等价于非随机形式（2.1.4）式。随机误差项 μ 的条件同方差假设意味着 μ 的方差不依赖于 X 的变化而变化，且总为常数 σ^2 。在 μ 的条件零均值与条件同方差假设下，总体回归函数可显示为图2.2.1。需要注意的是，当随机误差项 μ 的条件零均值假设成立时，根据期望迭代法（Law of iterated expectation）一定有如下非条件零均值性质：同样地，随机误差项 μ 的条件同方差假设成立时，根据期望迭代法则一定有如下非条件同方差性质。

1、作者是国内计量经济学界的权威，本书可谓是呕心沥血的经典之作。本书有以下几个特点：1、不光讲模型和方法本身，而是讲怎么设立模型、怎么选变量、怎么设定变量间的关系等一些非常基本的问题，这是本书和其他教材不一样的重要一点。尤其是最后一章，写得酣畅淋漓，读完令人有茅塞顿开之感。现在经常能够看到一些论文，也不管经济学原理是什么，上来先找几个变量，然后一回归，系数显著，就说XX是YY的原因。须知计量经济学首先是经济学，其次才是运用了统计学的方法，再眩的模型，再眩的统计方法，脱离了经济含义，就有如无源之水。这一点，对于经济学的入门者来说非常重要，统计和数学不能代替经济学本身。学了第9章以后，就明白现在很多经济学研究的问题出在哪里，自己以后应该怎么做研究，怎么建模型；2、全。基本上覆盖了中级计量经济学的主要内容，读者完全可以在学完后把本书当工具书备查。3、明。原理说的清楚，公式写的明白，图示易于理解，例题凝炼精华，分析切中要害。4、尖。和多元统计着实地区别开来，大的方向说清楚了，为读者学习更高级的课程做好必要的准备。5、必要的简。本书和《计量经济学学习指南与练习》应一起阅读，本书中大量的数学证明都在指南与练习中。6、字字珠玑，值得精读，我读书的时间比较零碎，这本书前后看了有两三个月，如果能够有完整的时间看书，估计40小时左右可以学完。但是本书仍然有一些缺点，比如非常极少数的文字错误，极少部分内容略显重复，此外，全书稍有一点拼接感，系统性不像国外教材那么强，学完后读者并不能迅速得到一个整体的感知，需要消化总结才可以，相比之下，国外的教材一般会有清晰的主线和系统性。另外，书后也缺一个索引，建议再版时加上，读者想到什么概念时查起来好查。瑕不掩瑜，在国内的诸多教材中，这本的确是经典上乘之作。如果要开始做经济学的研究，一定要好好读。以下是最初写书评两月之后写的：最近结合《计量经济学学习指南与练习》重看了这本书，顺便也看了一些其他的计量经济学和Eviews教材，觉得本书和其他教材相比，好就好在一方面覆盖的内容足够广，另一方面却能做到适可而止，比如有的书会把各种模型及检验方法洋洋洒洒都列齐，但都是蜻蜓点水，看完了不知所云。而本书列的模型没那么多，却能做到深入浅出，至少列出的模型可以较好的理解和掌握。计量绝不是模型的简单罗列，在运用模型的时候，一定要知道为什么用，以及怎么用。还有一个明显的感觉是本书在时间序列这部分的内容需要再加强一些，比如怎么识别ARMA模型，correlogram检验和单位根检验什么关系，出现矛盾的结果怎么办并没有讲清楚，在《指南与练习》里也没有讲清楚。不过仍然是瑕不掩瑜，本来想改成四星，但考虑到本书和国内其他书比的确是强一截，就还给五星了。

2、这学期我们的计量经济学学的就是这本书。我平时是和伍德里奇的《计量经济学导论》一起看的，所以两本书的特点在对比中就很明显。这本书的例子比较少（如果觉得多那是因为没看另外一本），而且相对来说比较注重数学上的计算。由于在计量领域用Eviews很方便，而且比较流行，所以说注重Eviews是这本书的一个优点（伍德里奇的基本上用excel）。它比较薄，但基本上又做到了每个面都讲到（比如说一些关于异方差中的检验方法），这不可避免的使得有些内容真的只是讲讲而已——连过程和例子都没有。但是这也使得我们比较好用愉快轻松地方式入门——真的只是入门，因为它在某些逻辑上甚至是混乱的。比如我今天和老师聊得一个内容，时间序列里面的第一个例子，它对平稳性的推断就说的不清不楚。顺带一提，我们老师上课除了例子，基本上都不按书上的讲。而伍德里奇的话，详细的可以去看我在那本书的书评。简单点说，它对思维的培养是很有益的——因为它例子极其丰富，在思路中的每个变化都有解释。但同时，作为一本面向广大群众（包括那些完全不懂经济）的书，它的数学使用实在是太谨慎了，以至于有时候看起来缺少说服力。但是放心，看了李子奈的就会知道，计算远比思路来的简单。总的来说，这本书可以一看。但是想培养学科的直觉和思路，我还是支持伍德里奇。

章节试读

1、《计量经济学》的笔记-第9页

建模的步骤和要点

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：www.tushu111.com