

# 《计量经济学》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2011年03月01日

开本：16开

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787550400627

## 内容简介

《计量经济学》是适合于经济学、管理学门类各专业高年级本科生和非数量经济学专业低年级研究生使用的一部计量经济学专著性教材，也可以作为在社会、经济、管理等领域从事计量经济分析的研究人员的参考书。该书系统介绍了经典计量经济学的基本理论、方法，以及为避免“伪回归现象”的发生而发展起来的协整理论的基本内容，并将它们纳入一个完整的体系之中。全书共分八章：第1章是绪论，主要介绍了什么是计量经济学以及计量经济学研究问题的基本步骤；第2、3章介绍了经典一元和多元线性回归模型的基本理论、方法及其在经济分析中的应用，以及可线性化的非线性回归模型的估计问题；第4章是关于违背基本假定条件的线性回归模型的讨论，包括多重共线性、异方差性、自相关性和\*解释变量问题等；第5章是关于模型设定的几个专门问题，包括解释变量选取的偏误、线性约束的F检验、模型选择的准则和虚拟解释变量模型等；第6章介绍了分布滞后变量模型的基本理论和方法；第7章是关于联立方程模型的讨论；第8章讨论了单位根检验、协整检验和误差修正模型的建立问题。

## 目录

### 1 绪论

§ 1.1 什么是计量经济学

§ 1.2 经典计量经济学的建模步骤

§ 1.3 计量经济模型的应用

§ 1.4 阅读本书需要的数学知识

练习题

### 2 一元线性回归模型

§ 2.1 回归分析与回归模型

§ 2.2 基本概念及普通最小二乘法

§ 2.3 总体回归模型的基本假定及OLS估计量的统计性质

§ 2.4 拟合优度的度量

§ 2.5 回归系数的假设检验及其区间估计

§ 2.6 预测

§ 2.7 案例分析

[显示全部信息](#)

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.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)