

计量经济学



[计量经济学 下载链接1](#)

著者:潘省初

出版者:人民大学

出版时间:2007-3

装帧:平装

isbn:9787300072043

为了使学内容跟上计量经济学的量新发展，能够反映本领域科研和教学的最新成果，本书第二版在保留第一版基本结构的基础上，对内容做了较大幅度的修改。增加的主要内容包括：面板数据模型，定性选择模型，极大似然估计，模型的选择，格兰杰因果关系检验，Hendry动态建模方法以及第一版中未予介绍的若干检验方法。各章习题的数量也有了显著的增加。

全书共分十章。第一章：绪论；第二章：计量经济分析的统计学基础，第三章：双变量线性回归模型；第四章：多元线性回归模型；第五章：模型的建立与估计中的问题（误设定、多重共线性、异方差性、自相关）及对策；第六章，动态经济模型；第七章：回归模型和分布滞后模型第七章：时间序列分析；第八章：联立方程模型；第九章：面板数据模型；第十章：定性选择模型。每章内容之后附有本章小结和习题。

作者介绍:

潘省初，现任中央财经大学统计学院教授，博士生导师。1969年毕业于北京大学数学力学系，1983年毕业于清华大学经济管理工程系，获工学硕士学位。1983年起在中央财经大学任教至今，其间曾赴英国利物浦大学、剑桥大学和美国马里兰大学做访问学者。

或进行合作研究，历时两年。主要研究领域为数量经济学和产业经济学，致力于经济模型的研究，包括宏观经济模型、多部门动态模型和能源模型的研制与应用。科研成果中两项获部级科技进步奖三等奖，发表论文二十余篇，有《应用经济统计学》、《投入产出经济学》、《计量经济学》等著译作八部。1993年起享受国务院颁发的政府特殊津贴。

目录: 第一章 绪论

第一节 什么是计量经济学

第二节 计量经济学方法

第三节 计量经济模型及其应用

第四节 统计和计量经济分析软件

小结

习题

第二章 计量经济分析的统计学基础

第一节 概率和概率分布

第二节 统计推断

第三节 参数估计

第四节 假设检验

小结

习题

第三章 双变量线性回归模型

第一节 双变量线性回归模型的估计

第二节 最小二乘估计量的性质

第三节 拟合优度的测度

第四节 双变量回归中的区间估计和假设检验

第五节 预测

第六节 有关最小二乘法的进一步讨论

第七节 极大似然法

小结

习题

第四章 多元线性回归模型

第一节 多元线性回归模型的概念

第二节 多元线性回归模型的估计

第三节 拟合优度

第四节 非线性关系的处理

第五节 假设检验

第六节 预测

第七节 虚拟变量

小结

习题

附录：正定矩阵

第五章 模型的建立与估计中的问题及对策

第一节 误设定

第二节 多重共线性

第三节 异方差性

第四节 自相关

小结

习题

第六章 动态经济模型：自回归模型和分布滞后模型

第七章 时间序列分析

第八章 联立方程模型

第九章 面板数据模型

第十章 定性选择模型

附录 统计表

参考文献

· · · · · (收起)

[计量经济学](#) [下载链接1](#)

标签

经济学

教材

评论

[计量经济学](#) [下载链接1](#)

书评

[计量经济学](#) [下载链接1](#)