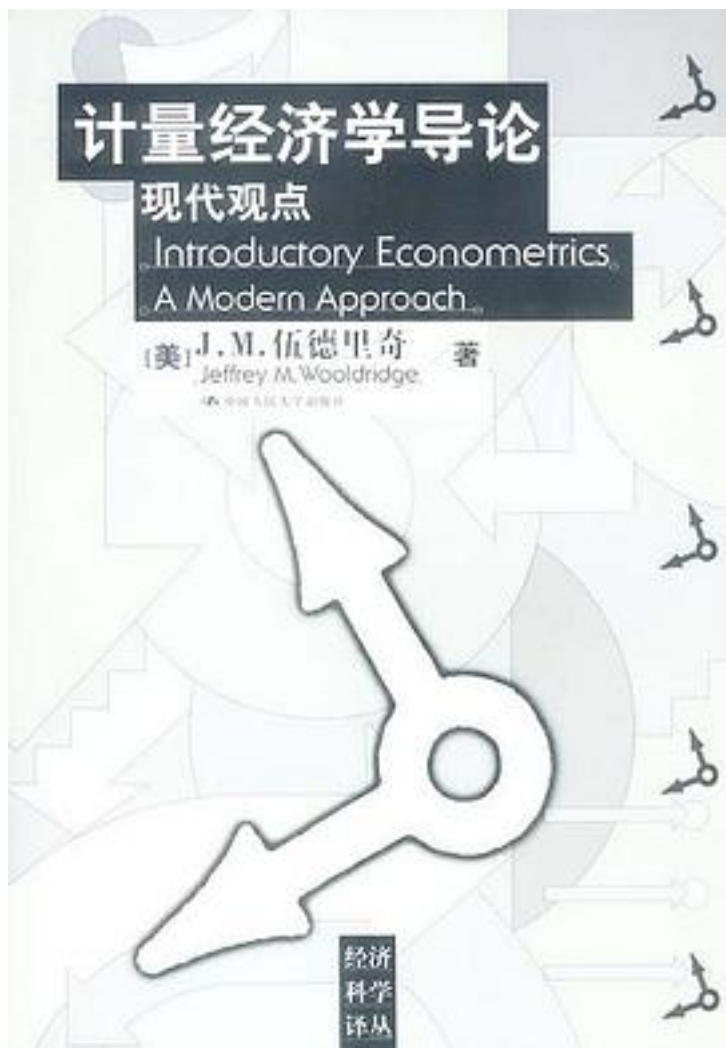


计量经济学导论



[计量经济学导论_下载链接1](#)

著者:杰弗里·M·伍德里奇

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2015-5

装帧:平装

isbn:9787300208152

《计量经济学导论：现代观点（第五版）/经济科学译丛；“十一五”国家重点图书出版规划项目》是一本经典的初级计量经济学教材，语言通俗易懂，且辅以恰到好处的案例指导学生学习与运用计量方法。与传统的教材不同，本书在陈述和解释假定时，作者完全放弃了非随机的或在重复样本中加以固定的回归元假定。这种方法更便于读者对计量经济学的理解和应用，是对传统计量经济学教学和研究的一个突破。本书的主要特点是：

(1) 不需要具备高深的数学知识，读者只要掌握大学所学的线性代数和概率统计基础知识即可。

(2) 强调计量经济学在实际问题中的应用。

(3) 含有大量例题和练习题。章末习题和计算机习题多着重于经验研究而非复杂的推导。要求学生能根据所学知识仔细地推理。

(4) 课程安排比较灵活。教师可以根据教学需要合理挑选章节进行讲授，而不会影响教学的连续性。

(5) 本书英文原版书配有内容丰富的网络教学资源，包括教学手册、多媒体教学课件、试题库等。

《计量经济学导论：现代观点（第五版）/经济科学译丛；“十一五”国家重点图书出版规划项目》适合各高等院校经济管理类专业本科生作为计量经济学教材，还可供经济管理类教师及科研人员作为参考书使用。

作者介绍:

杰弗里·M·伍德里奇，是密歇根州立大学经济学特聘教授，1991年以来一直在该校任教。1986—1991年，伍德里奇博士曾是麻省理工学院的经济学助教。他于1982年在加州大学伯克利分校获得计算机科学与经济学学士学位，并于1986年在加州大学圣迭戈分校获经济学博士学位。伍德里奇博士曾在国际知名期刊上发表了30多篇学术论文，参与过多部著作中的篇章写作。他还是《横截面与面板数据的计量经济分析》(Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data)一书的作者。他所获的奖项包括：斯隆(Alfred P. Sloan)研究奖，《计量经济理论》(Econometric Theory)的Plura Scripsit奖，《应用计量经济学杂志》(Journal of Applied Econometrics)的斯通(Richard Stone)爵士奖，以及在MIT三次获得研究生教学年度优秀教师奖。他还是计量经济学会(Econometric Society)和《计量经济学杂志》(Journal of Econometric)的资深会员。

目录: 第1章 计量经济学的性质与经济数据

- 1. 1 什么是计量经济学
- 1. 2 经验经济分析的步骤
- 1. 3 经济数据的结构
- 1. 4 计量经济分析中的因果关系和其他条件不变的概念

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第一篇 横截面数据的回归分析

第2章 简单回归模型

- 2. 1 简单回归模型的定义
- 2. 2 普通最小二乘法的推导

- 2. 3 OLS的操作技巧
- 2. 4 度量单位和函数形式
- 2. 5 OLS估计量的期望值和方差
- 2. 6 过原点回归及对常数回归

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第3章 多元回归分析：估计

- 3. 1 使用多元回归的动因
- 3. 2 普通最小二乘法的操作和解释
- 3. 3 OLS估计量的期望值
- 3. 4 OLS估计量的方差
- 3. 5 OLS的有效性：高斯马尔科夫定理
- 3. 6 对多元回归分析语言的一些说明

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第4章 多元回归分析：推断

- 4. 1 OLS估计量的抽样分布
- 4. 2 检验对单个总体参数的假设：t检验
- 4. 3 置信区间
- 4. 4 检验关于参数的一个线性组合假设
- 4. 5 对多个线性约束的检验：F检验
- 4. 6 报告回归结果

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第5章 多元回归分析：OLS的渐近性

- 5. 1 一致性
- 5. 2 渐近正态和大样本推断
- 5. 3 OLS的渐近有效性

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第6章 多元回归分析：深入专题

- 6. 1 数据的测度单位对OLS统计量的影响
- 6. 2 对函数形式的进一步讨论
- 6. 3 拟合优度和回归元选择的进一步探讨
- 6. 4 预测和残差分析

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第7章 含有定性信息的多元回归分析：二值（或虚拟）变量

- 7. 1 对定性信息的描述
- 7. 2 只有一个虚拟自变量
- 7. 3 使用多类别虚拟变量
- 7. 4 涉及虚拟变量的交互作用
- 7. 5 二值因变量：线性概率模型
- 7. 6 对政策分析和项目评价的进一步讨论

7. 7 离散因变量的回归结果解释

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第8章 异方差性

8. 1 异方差性对OLS所造成的影响

8. 2 OLS估计后的异方差—稳健推断

8. 3 对异方差性的检验

8. 4 加权最小二乘估计

8. 5 再议线性概率模型

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第9章 模型设定和数据问题的深入探讨

9. 1 函数形式误设

9. 2 对法观测解释变量使用代理变量

9. 3 随机斜率模型

9. 4 有测量误差时OLS的性质

9. 5 数据缺失、非随机样本和异常观测

9. 6 最小绝对离差估计

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第二篇 时间序列数据的回归分析

第10章 时间序列数据的基本回归分析

10. 1 时间序列数据的性质

10. 2 时间序列回归模型的例子

10. 3 经典假设下OLS的有限样本性质

10. 4 函数形式、虚拟变量和指数

10. 5 趋势和季节性

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第11章 OLS用于时间序列数据的其他问题

11. 1 平稳和弱相关时间序列

11. 2 OLS的渐近性质

11. 3 回归分析中使用高度持续性时间序列

11. 4 动态完备模型和序列相关

11. 5 时间序列模型的同方差假定

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第12章 时间序列回归中的序列相关和异方差性

12. 1 含序列相关误差时OLS的性质

12. 2 序列相关的检验

12. 3 回归元严格外生时序列相关的修正

12. 4 差分和序列相关

12. 5 在OLS后的序列相关—稳健推断

12. 6 时间序列回归中的异方差性

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第三篇 高级专题讨论

第13章 跨时横截面的混合：简单面板数据方法

13. 1 跨时独立横截面的混合

13.2 利用混合横截面做政策分析

13. 3 两时期面板数据分析

13. 4 用两期面板数据做政策分析

13. 5 多于两期的差分法

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第14章 高级的面板数据方法

14. 1 固定效应估计法

14. 2 随机效应模型

14. 3 相关随机效应方法

14. 4 把面板数据方法用于其他的数据结构

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第15章 工具变量估计与两阶段最小二乘法

15. 1 动机：简单回归模型中的遗漏变量

15. 2 多元回归模型的IV估计

15. 3 两阶段最小二乘

15. 4 变量误差问题的IV解决方法

15. 5 内生性检验与过度识别约束检验

15. 6. 异方差条件下的2SLS

15. 7 2SLS应用于时间序列方程

15. 8 2SLS应用于混合横截面和面板数据

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第16章 联立方程模型

16. 1 联立方程模型的性质

16. 2 OLS中的联立性偏误

16. 3 结构方程的识别和估计

16. 4 多于两个方程的系统

16. 5 利用时间序列的联立方程模型

16. 6 利用面板数据的联立方程模型

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第17章 限值因变量模型和样本选择纠正

17. 1 二值响应的对数单位和概率单位模型

17. 2 用于角点解响应的托宾模型

17. 3 泊松回归模型

17. 4 删截和断尾回归模型

17. 5 样本选择纠正

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第18章 时间序列高级专题

18. 1 限分布滞后模型

18. 2 单位根检验

18. 3 伪回归

18. 4 协整和误差修正模型

18. 5 预测

本章小结

关键术语

习题

计算机练习

第19章 一个经验项目的实施

19. 1 问题的提出

19. 2 文献回顾

19. 3 数据的收集

19. 4 计量经济分析

19. 5 实证论文的写作

本章小结

关键术语

样本经验项目

期刊列表

数据资源

附录

附录2A 第2章附录

最小化残差平方和

附录3A 第3章附录

3A. 1 对方程(3. 13) 中一阶条件的推导

3A. 2 对方程(3. 22) 的推导

3A. 3 对定理3. 1的证明

3A. 4 一般情形中的遗漏变量偏误

3A. 5 对定理3. 2的证明

3A. 6 对定理3. 4的证明

附录5A 第5章附录

附录6A 第6章附录

自助法简介

附录13A 第13章附录

13A. 1 用一阶差分做混合OLS的假定

13A. 2 计算未知形式异方差和序列相关的稳健标准误

附录14A 第14章附录

14A. 1 关于固定效应和随机效应的假定

14A. 2 固定效应和随机效应的对异方差与序列相关的

稳健标准误

附录15A 第15章附录

15A. 两阶段最小二乘的假定

15A. 2 假定2SLS. 1(参数的线性)

15A. 3 假定2SLS. 2(随机抽样)

15A. 4 假定2SLS. 3(秩条件)

15A. 5 假定2SLS. 4(外生工具变量)

15A. 6 定理15A. 1

15A. 7 假定2SLS. 5(同方差性)

15A. 8 定理15A. 2

15A. 9 定理15A. 3
15A. 10 假定2SLS. 6(序列相关)
附录17A 第17章附录
17A. 1 含解释变量的极大似然估计
附录17B 第17章附录
17B. 1 限值因变量模型中的渐近标准误
附录A 基本数学工具
A. 1 求和算子与描述统计量
A. 2 线性函数的性质
A. 3 比例与百分数
A. 4 若干特殊函数及其性质
A. 5 微分学
本章小结
关键术语
习题
附录B 概率论基础
B. 1 随机变量及其概率分布
B. 2 联合分布、条件分布与独立性
B. 3 概率分布的特征
B. 4 联合与条件分布的特征
B. 5 正态及其有关分布
本章小结
关键术语
习题
附录C 数理统计基础
C. 1 总体、参数与随机抽样
C. 2 估计量的有限样本性质
C. 3 估计量的渐近或大样本性质
C. 4 参数估计的一般方法
C. 5 区间估计与置信区间
C. 6 假设检验
C. 7 关于符号的备注
本章小结
关键术语
习题
附录D 矩阵代数概述
D. 1 基本定义
D. 2 矩阵运算
D. 3 线性独立与矩阵的秩
D. 4 二次型与正定矩阵
D. 5 幂等矩阵
D. 6 线性形式和二次型的微分
D. 7 随机向量的矩和分布
本章小结
关键术语
习题
附录E 矩阵形式的线性回归模型
E. 1 模型与普通最小二乘估计
E. 2 OLS的有限样本性质
E. 3 统计推断
E. 4 某些渐近分析
本章小结
关键术语
习题

附录F 各章思考题答案

附录G 统计用表

参考文献

术语表

译后记

• • • • • (收起)

[计量经济学导论_下载链接1_](#)

标签

计量经济学

经济学

金融

教材

统计学

经济学-方法-计量

经济

econometrics

评论

总算看完了，主体部分还是很好的。面板两章写得过于繁琐而层次不清，第5版翻译没什么问题但居然有几处数学公式写错了。接下来开始看Mostly Harmless Econometrics。经济学教材价格眼看着就要变成3位数了...

需要读好多遍才行。

疫情期间

简单明了，学到不少东西。

作为一本导论性作品，该有的优点都有了

基础工具，需要牢固掌握。

翻译不好，拖泥带水

计量教材，上接统计学基础，下开时间序列，逻辑清晰，详略得当，体系严密。

讲得很详细清楚。不过学得囫圇吞枣……学计量不应用不行啊

也算是看完了吧……

感恩 这学期分数最高的一门课

翻译的语言不仅晦涩难懂，而且错误多到无法容忍。真的只能当作参考。。。

第一篇翻译的还行，时间序列部分还没看，第三篇翻译的完全不知道在讲什么

研究生入门教材。有些学校本科生也用这本书。还是需要一些统计基础

摇了我吧

不学数学，智商是会下降的。

条理清晰，例子很多适合自学。配上陈强的高级计量经济学做实操，简直完美。

[计量经济学导论 下载链接1](#)

书评

题记

IV，也就是工具变量模型，是研究如何利用工具变量来解决模型中出现的随机解释变量问题，其是西方计量经济学最近一个较为热门的研究领域。这是我在英国读研时在学习IV时的随笔，用来聊以自慰。该随笔的灵感很大一部分来自于伍德里奇的《计量经济学导论》。由于写得非常浅薄...

高年级本科、硕士水平的经典计量经济教材！这本书绝对可以用“漂亮”二字概括，费剑平翻译的也很好，错误极少。少量的印刷错误主要集中于附录，可在网上下载本书英文电子版加以对照。
针对本科水平而言（侧重应用研究），本书Ch1--10, Ch12--16都是必学章节，基本上...

首先，一定要看英文版，这本书最大的优点在于：案例丰富，经济意义描述清晰，让人不会陷入数学的谜团，知道“计量经济学”是一门“经济学”而不是“数学”！！！一般情况下，学完初级微观宏观就可以尝试看这本英文书。

最大的缺点在于：主体按照OLS估计，很少涉及MLE，GMM，但...

适合中级水平的书，是经济学领域较好的教材，但不是最好的教材，好的教材很多。其他学科的相关教材也很好。

第四版阉割了很多内容，国内的出版商无耻的很，而且字很小，印刷质量很一般。和国外的印刷质量比起来，差别太大。建议网上搜电子版的看或者买第三版。

建议先看一些入...

人大版翻译的国外经典教材真难读，糟糕的翻译，似乎译者不是中国人，如此这般的书面表达真让人佩服，还存在很多错误，对人大这套丛书失望透了。
再也不敢买人大翻译的书了。译者太不负责任了，不要因为翻译国外书不作为学术研究而急功近利，只为拿点翻译费。跟高鸿业花3年翻...

这是本非常漂亮的学术著作 读起来很愉悦 虽然在技术上不是很难
但对计量经济学的解说却非常到位 同时例子也非常丰富 如果能够认真看过两遍
作出合适的实证研究应该不是问题 稍微指出一点瑕疵：
就是这本书在印刷上存在一定的错误（非常少的地方存在翻译错误） ...

这本书我只啃了6章和后面的appendixA-C，Research
Method的这门课只这些内容。我本科没有学过计量经济学，统计学也等于没学过，所以RM这门课开的时候我等于听天书，开课时pro知道我非金融背景问我有没有学过计量经济学，我就知道这门课又是异常痛苦了。过完圣诞之后我才从图书...

书本身当然是没问题的 但是要提示一下想买英文原版的人
这个引进版删除了附录A-D，其中很多内容我觉得还是挺重要的~
其次，有的chapter可能前言比较长，出版社就删除了第一页，但这有时会导致该chapter第一个equation也顺带着被删除了，大家一定要留意。至于第六版英文原版现...

Great book for elementary learners in econometrics. Introduces the basic concept of econometrics by intuitively describe the thinking process underlying the main idea of econometric models. Thoroughly covers basic cross-sectional methods, then provides a we...

其实主要内容就是Multiple Regression Analysis。内容经典，听说是国内许多经济系的课本。理论性偏强，不够实用化。不过从另一方面来讲，范例讲的都比较明白。强烈推荐附录里关于“如何做实证研究”的指南文章。完全是DIY研究的完整的to do list啊！以后做研究就照着这上面...

译者文字功底不行，文字很生硬，看得很蛋疼，前后两句话不知道有什么因果关系~远不如萨缪尔森那本经济学翻译得友好

分成上下册两本，纸质纯木浆制作，很白很光滑，是中文版的，美中不足就是后面的索引部分页码不对（因为是直接从英文版翻译过来的），不过还好吧，配合着英文版看就Perfect了，就是书比较贵。

这是一本老师和同学都极力推荐的书 可是自己硬是啃不动 一方面是大部头看着就觉得心里发毛 另一方面是数学功底的欠缺让自己看得实在吃力 学习计量看来还是得选择符合自己的方法 目前而言，做一个小研究，学会一种方法，这种散兵作战的方式还是比较合适的。至于这本大部头， ...

[计量经济学导论 下载链接1](#)