

计量经济学



[计量经济学_下载链接1](#)

著者:赵卫亚//彭寿康//朱晋

出版者:机械工业

出版时间:2008-9

装帧:

isbn:9787111250852

《高等院校精品课程系列教材·计量经济学》注重理论、方法的基本原理和具体应用，尽量避免烦琐的数学推导；精简整合了计量经济学的内容，简化了单方程模型的理论推导过程，省略了联立方程模型内容，充实了协整理论和误差修正模型、ARCH类模型、离散数据模型等内容；强调计量经济方法的具体应用，尤其是在金融领域的应用；以计量经济分析软件——EViews和SAS作为教学支持软件，教学内容中始终贯穿了EViews的具体使用，并根据金融数据的特点介绍了SAS软件的计量经济分析过程。

《高等院校精品课程系列教材·计量经济学》可以作为高等院校经济管理类本科各专业的计量经济学课程教材，也可以作为非计量经济学专业研究生的辅助教材，还可以作为经济管理部门、金融业技术分析人员的计量经济学自学教材或参考书。

作者介绍:

目录: 出版前言 前言 教学建议 第1章 绪论 1.1 什么是计量经济学 1.2 计量经济学与其他学科的关系 1.3 计量经济研究的步骤 1.4 计量经济学的发展 1.5 计量经济分析软件 本章小结 思考与练习 第2章 回归模型 2.1 回归分析概述 2.2

一元线性回归模型 2. 3 多元线性回归模型 2. 4 回归模型的统计检验 2. 5 预测 2. 6
非线性回归模型 案例分析：伦敦铜期货价格模型 本章小结 思考与练习第3章
回归模型的扩展 3. 1 异方差性 3. 2 自相关性 3. 3 多重共线性 3. 4 虚拟变量
案例分析：香港恒生指数影响因素分析 模型 本章小结 思考与练习第4章 时间序列模型
4. 1 随机时间序列模型概述 4. 2 时间序列的平稳性及其检验 4. 3
时间序列的格兰杰因果检验 案例分析：银行股与上证指数的因果关 系检验 本章小结
思考与练习第5章 协整与误差修正模型 5. 1 变量的协整关系与协整检验 5. 2
误差修正模型 案例分析：我国金融发展与经济增长的 协整分析 本章小结
思考与练习第6章 ARCH模型及其扩展形式 6. 1 ARCH模型及其扩展形式概述 6. 2
ARCH效应检验 6. 3 GARCH类模型的估计与检验
案例分析：GARCH类模型在金融领域的应用 本章小结 思考与练习第7章
离散因变量模型与受限因变量模型 7. 1 线性概率模型及其存在的问题 7. 2
Logstie回归和Probit过程 7. 3 排序选择模型 7. 4 Tobit模型 本章小结
思考与练习第8章 SAS软件简介与金融数据分析 8. 1 SAS系统简介 8. 2
SAS系统的数据库 8. 3 金融数据分析——回归分析 8. 4 金融数据分析——时间
序列分析 本章小结 思考与练习第9章 金融实证论文写作 9. 1
金融市场理论与计量经济方法 9. 2 金融实证论文写作框架 本章小结
思考与练习附录参考文献
• • • • • (收起)

[计量经济学 下载链接1](#)

标签

经济学

教材

评论

这本书是我的计量经济学入门，都是该学科的基础知识，但是讲解的非常明确，数学的部分也恰到好处，并不会特别难懂，很有启发。

虽然只学了点皮毛 但是那种跟着教材数学推导的过程真的极具快感 仅次于概率论
放下含糊的自说自圆的经济学理论 完全进入一个清晰严密客观的逻辑的世界
简直是一阵清风……

听课跟听。。一样。。都是矩阵。。好难 T^T

[计量经济学 下载链接1](#)

书评

[计量经济学 下载链接1](#)