

# 计量经济学指南



[计量经济学指南\\_下载链接1](#)

著者:皮特·肯尼迪

出版者:中国人民大学出版社

出版时间:2010-6

装帧:平装

isbn:9787300123332

《计量经济学指南(第5版)》内容简介：计量经济学以经济理论和统计数据为基础，运

用数学和统计学方法，以建立经济计量模型为主要手段，定量分析研究经济变量之间的关系。《计量经济学指南》（第五版）用简洁、准确的语言全面总结了计量经济学的主要内容和最新发展。与传统的教材不同，在陈述和解释各种计量模型时，作者特别强调对计量经济学基本概念和技术过程的直觉感受，而将进一步讨论的细节和技术材料，都分别归入每章之后的“一般性注释”和“技术性注释”中，从而保证非常好的可读性。《计量经济学指南》（第五版）已经被公认为是世界各地师生首选的教科书。通过对《计量经济学指南(第5版)》的学习，读者可以系统地掌握现代计量经济学的基本原理和基本方法，并且具备一定的建立计量经济学模型进行实证研究的能力。

作者介绍:

皮特·肯尼迪（Peter Kennedy）是Simon Fraser大学的经济学教授。除《计量经济学指南》外，他还著有《宏观经济学精要：了解新闻中的经济学》（第二版，2000），同时他担任了《国际预测期刊》、《经济学教育期刊》和《经济学公报》的副主编。

目录: 第1章引言 1.1 什么是计量经济学 1.2 干扰项 1.3 估计和估计量 1.4 良好和首选的估计量 一般性注释 技术性注释第2章 估计量标准 2.1 引言 2.2 计算成本 2.3 最小二乘 2.4  $R^2$ 最大 2.5 无偏性 2.6 有效性 2.7 均方误差(MSE) 2.8 渐近性 2.9 最大似然 2.10 蒙特卡罗研究 2.11 总结 一般性注释 技术性注释第3章 古典线性回归模型 3.1 作为一览表的教科书 3.2 五个假设 3.3 CLR模型中的OLS估计量 一般性注释 技术性注释第4章 区间估计和假设检验 4.1 引言 4.2 单一假设的检验: t检验 4.3 联合假设的检验: F检验 4.4 参数向量的区间估计 4.5 LR, W和LM统计量 4.6 自举法 一般性注释 技术性注释第5章 设定 5.1 引言 5.2 三种方法 5.3 设定的一般原理 5.4 错误设定检验/诊断 5.5 再说R 一般性注释 技术性注释第6章 违反假设一: 错误回归元, 非线性和参数非常数 6.1 引言 6.2 错误的自变量集 6.3 非线性 6.4 变化的参数值 一般性注释 技术性注释第7章 违反假设二: 干扰项的期望非零 不变的非零均值 零截距 有限因变量 边界生产函数 对数变换 一般性注释第8章 违反假设三: 非球状干扰项 8.1 引言 8.2 违背的后果 8.3 异方差 8.4 自相关干扰项 一般性注释 技术性注释第9章 违反假设四: 测量误差和自回归 9.1 引言 9.2 工具变量估计 9.3 变量中的误差 9.4 自回归 一般性注释 技术性注释第10章 违反假设四: 联立方程 10.1 引言 10.2 识别 10.3 单方程方法 10.4 系统方法 一般性注释 技术性注释第11章 违反假设五: 多重共线性 11.1 引言 11.2 后果 11.3 侦查多重共线性 11.4 对策 一般性注释 技术性注释第12章 引入外部信息 12.1 引言 12.2 确定约束条件 12.3 随机约束条件 12.4 预检验估计量 12.5 外部信息与MSE 一般性注释 技术性注释第13章 贝叶斯方法 13.1 引言 13.2 什么是贝叶斯分析 13.3 贝叶斯方法的优点 13.4 克服实践者的怨言 一般性注释 技术性注释第14章 虚拟变量 14.1 引言 14.2 解释 14.3 加入其他定性变量 14.4 与定量变量的相互影响 14.5 特定观测值虚拟变量 一般性注释 技术性注释第15章 定性因变量 15.1 二分因变量 15.2 多分因变量 15.3 有序logit/probit模型 15.4 计数 一般性注释 技术性注释第16章 有限因变量 16.1 引言 16.2 Tobit模型 16.3 样本选择 16.4 久期模型 一般性注释 技术性注释第17章 面板数据 17.1 引言 17.2 允许不同的截距 17.3 固定与随机效应 17.4 短期和长期 17.5 长而窄的面板数据 一般性注释 技术性注释第18章 时间序列计量经济学 18.1 引言 18.2 ARIMA模型 18.3 向量自回归(VAR) 18.4 误差修正模型 18.5 单位根检验 18.6 协积 一般性注释 技术性注释第19章 预测 19.1 引言 19.2 因果预测/计量经济学模型 19.3 时间序列分析 19.4 预测准确性 一般性注释 技术性注释第20章 稳健估计 20.1 引言 20.2 异常值和有影响的观测值 20.3 稳健估计量 20.4 非参数估计 一般性注释 技术性注释第21章 应用计量经济学 21.1 引言 21.2 应用计量经济学的十条圣训 21.3 获得了错误的符号 21.4 普遍错误 21.5 实践者需要了解什么 一般性注释 技术性注释附录A 抽样分布——统计的基础附录B 关于方差附录C 渐近理论入门附录D 习题附录E 编号为偶数的题目答案难词表词汇表参考文献关于翻译工作的说明

• • • • • [\(收起\)](#)

[计量经济学指南\\_下载链接1\\_](#)

## 标签

计量经济学

计量

经济学

经济

yy

econometrics

Methodology

F2经济计划与管理

## 评论

和传统计量经济学教科书的安排不一样，好书。

-----  
又一本经典教材被翻译成垃圾了！四颗星是给原著的！

-----  
太详细了！很适合我这种智商略低的人…

-----  
非常好。来龙去脉， 名词解释都有。

-----  
[计量经济学指南\\_下载链接1](#)

书评

-----  
[计量经济学指南\\_下载链接1](#)