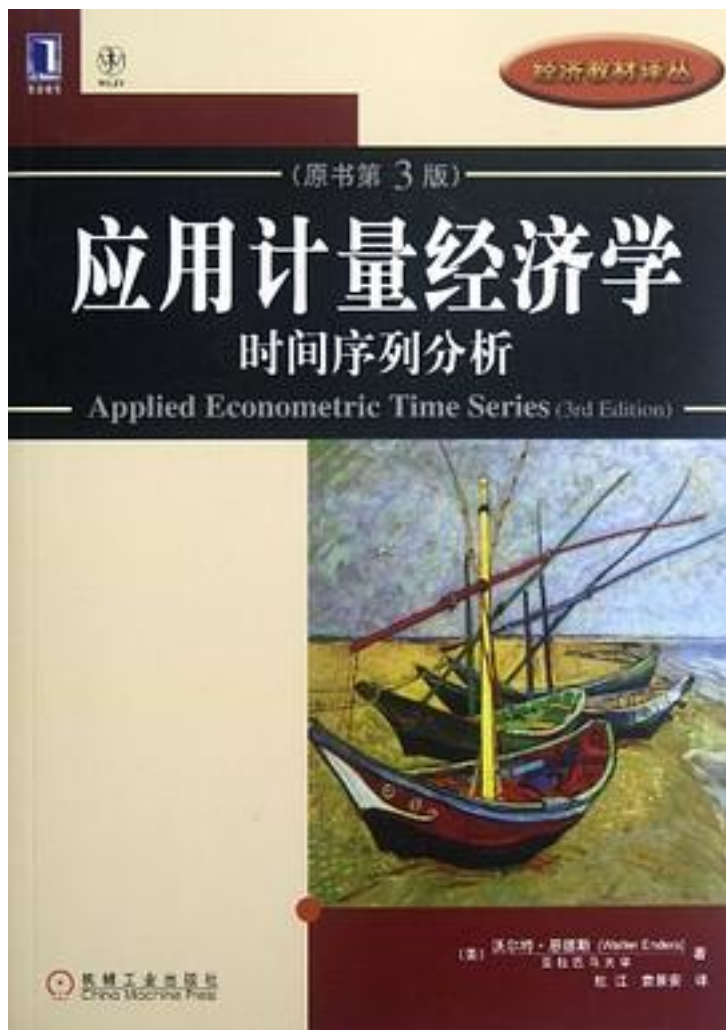


应用计量经济学



[应用计量经济学_下载链接1](#)

著者:A.H.施图德蒙德

出版者:机械工业出版社

出版时间:2011-8

装帧:平装

isbn:9787111355373

《应用计量经济学(第6版)》被誉为“近30年来最具重要性的创新性教材之一”，是美

国高校教授基础计量经济学的首选教材！全书简单、直观且通俗易懂地讲解了各类计量模型的设定方法、用途以及模型的解释等，几乎没有涉及数学推导。更为难得的是，作者用生动的语言讲解了假设检验的思想及其局限，也系统化地讲解了计量实证研究的各个步骤及注意事项，对学生如何做好国际研究项目提供了很多有意义的帮助。另外，作者还给出了大量实用有趣的案例及其原始数据，比如iPod在eBay的价格，预测总统选举结果，宽松的打分对“评教”网站的影响。好莱坞夜总会的出席情况，病人如何选择医院，等等，让读者更容易理解计量经济学。

《应用计量经济学(第6版)》不仅仅是针对计量经济学的初学者，还针对那些使用回归分析提高解决问题能力的应用者，以及那些经验丰富的从业者，可以作为他们一本更为方便实用的参考书。

作者介绍:

目录: 译者序

前言

教学建议

第1章 回归分析概论

1.1 什么是计量经济学

1.2 什么是回归分析

1.3 回归方程的估计

1.4 回归分析实例

1.5 应用回归分析解释住房价格

小结

第2章 普通最小二乘法

2.1 用普通最小二乘法估计单变量模型

2.2 用普通最小二乘法估计多元回归模型

2.3 评价回归方程的质量

2.4 估计模型的拟合优度

2.5 错用 R^2 的例子

小结

第3章 应用回归分析

3.1 回归分析的步骤

3.2 回归分析实例：餐厅选址

小结

第4章 古典模型

4.1 古典假设

4.2 正态分布的抽样分布

4.3 高斯-马尔科夫定理和普通最小二乘估计量的性质

4.4 标准计量经济学符号

小结

第5章 假设检验

5.1 什么是假设检验

5.2 t检验

5.3 t检验示例

5.4 t检验的局限

小结

附录5A F检验

第6章 模型设定：解释变量的选择

6.1 遗漏变量

6.2 不相干变量

6.3 误用模型设定准则的实例

6.4 设定搜索

6.5 选择解释变量的实例

小结

附录6A 其他设定准则

第7章 模型设定：函数形式的选择

7.1 常数项的应用和解释

7.2 备选函数形式

7.3 滞后解释变量

7.4 虚拟变量的应用

7.5 斜率虚拟变量

7.6 选择错误函数形式存在的

问题

小结

第8章 多重共线性

8.1 完全多重共线性与不完全多重共线性

8.2 多重共线性产生的后果

8.3 多重共线性的诊断

8.4 多重共线性的补救措施

8.5 最好不要修正多重共线性的实例

小结

附录8A SAT互动回归练习

第9章 序列相关性

9.1 纯序列相关和非纯序列相关

9.2 序列相关性的后果

9.3 杜宾—沃森检验

9.4 序列相关性的修正

小结

第10章 异方差性

10.1 纯异方差性和非纯异方差性

10.2 异方差性的后果

10.3 异方差性的检验

10.4 异方差性的补救措施

10.5 完整的实例

小结

第11章 回归课题研究

11.1 选择主题

11.2 收集数据

11.3 高级数据来源

11.4 对研究课题的实用性建议

11.5 撰写研究报告

11.6 回归分析的用户清单及应用指南

小结

附录11A 关于房价的互动练习

第12章 时间序列模型

12.1 动态模型

12.2 序列相关性和动态模型

12.3 Granger因果关系

12.4 谬误相关和非平稳性

小结

第13章 虚拟被解释变量模型估计方法

13.1 线性概率模型

13.2 二元logit模型

13.3 其他虚拟被解释变量模型估计方法

小结

第14章 联立方程模型
14.1 结构式方程和简约式方程
14.2 普通最小二乘法的偏误
14.3 二阶段最小二乘法
14.4 识别问题
小结
附录14A 变量误差
第15章 预测
15.1 什么是预测
15.2 比较复杂的预测
15.3 ARIMA模型
小结
第16章 实验和面板数据
16.1 经济学中的实验方法
16.2 面板数据
16.3 固定效应模型和随机效应模型
小结
第17章 统计学原理
17.1 概率分布
17.2 抽样
17.3 估计
小结
附录A 部分习题答案
附录B 统计表
• • • • • ([收起](#))

[应用计量经济学_下载链接1](#)

标签

经济学

计量

0

计量经济学

评论

: F224.0/0262-1

[应用计量经济学_下载链接1_](#)

书评

[应用计量经济学_下载链接1_](#)