

· 经 / 济 / 科 / 学 / 译 / 丛 ·

A Guide to Econometrics

(Sixth Edition)

计量经济学原理

(第六版)

[美] 彼得·肯尼迪 (Peter Kennedy) 著

 中国人民大学出版社



WILEY

· 经 / 济 / 科 / 学 / 译 / 丛 ·

A Guide to Econometrics

(Sixth Edition)

计量经济学原理

(第六版)

[美] 彼得·肯尼迪 (Peter Kennedy) 著

周尧 张伟等 译

中国人民大学出版社

· 北京 ·

图书在版编目 (CIP) 数据

计量经济学原理：第 6 版/(美) 肯尼迪著；周尧等译. —北京：中国人民大学出版社，2014. 6
(经济科学译丛)

ISBN 978-7-300-19342-7

I. ①计… II. ①肯… ②周… III. ①计量经济学-高等学校-教材 IV. ①F224. 0

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2014) 第 110047 号

经济科学译丛
计量经济学原理 (第六版)
[美] 彼得·肯尼迪 著
周尧 张伟 等译
Jiliang Jingjixue YuanLi

出版发行	中国人民大学出版社	
社 址	北京中关村大街 31 号	邮政编码 100080
电 话	010-62511242 (总编室)	010-62511770 (质管部)
	010-82501766 (邮购部)	010-62514148 (门市部)
	010-62515195 (发行公司)	010-62515275 (盗版举报)
网 址	http://www.crup.com.cn	
	http://www.ttrnet.com (人大教研网)	
经 销	新华书店	
印 刷	涿州市星河印刷有限公司	
规 格	185 mm×260 mm 16 开本	版 次 2014 年 6 月第 1 版
印 张	35.75 插页 2	印 次 2014 年 6 月第 1 次印刷
字 数	790 000	定 价 69.80 元

版权所有 侵权必究 印装差错 负责调换

《经济学译丛》编辑委员会

学术顾问 高鸿业 王传纶 胡代光

范家骧 朱绍文 吴易风

主 编 陈岱孙

副主编 梁 晶 海 闻

编 委 (按姓氏笔画排序)

王一江 王利民 王逸舟

贝多广 平新乔 白重恩

刘 伟 朱 玲 许成钢

张宇燕 张维迎 李 扬

李晓西 李稻葵 杨小凯

汪丁丁 易 纲 林毅夫

金 碚 姚开建 徐 宽

钱颖一 高培勇 梁小民

盛 洪 樊 纲

《经济科学译丛》总序

中国是一个文明古国，有着几千年的辉煌历史。近百年来，中国由盛而衰，一度成为世界上最贫穷、落后的国家之一。1949年中国共产党领导的革命，把中国从饥饿、贫困、被欺侮、被奴役的境地中解放出来。1978年以来的改革开放，使中国真正走上了通向繁荣富强的道路。

中国改革开放的目标是建立一个有效的社会主义市场经济体制，加速发展经济，提高人民生活水平。但是，要完成这一历史使命绝非易事，我们不仅需要从自己的实践中总结教训，也要从别人的实践中获取经验，还要用理论来指导我们的改革。市场经济虽然对我们这个共和国来说是全新的，但市场经济的运行在发达国家已有几百年的历史，市场经济的理论亦在不断发展完善，并形成了一个现代经济学理论体系。虽然许多经济学名著出自西方学者之手，研究的是西方国家的经济问题，但他们归纳出来的许多经济学理论反映的是人类社会的普遍行为，这些理论是全人类的共同财富。要想迅速稳定地改革和发展我国的经济，我们必须学习和借鉴世界各国包括西方国家在内的先进经济学的理论与知识。

本着这一目的，我们组织翻译了这套经济学教科书系列。这套译丛的特点是：第一，全面系统。除了经济学、宏观经济学、微观经济学等基本原理之外，这套译丛还包括了产业组织理论、国际经济学、发展经济学、货币金融学、公共财政、劳动经济学、计量经济学等重要领域。第二，简明通俗。与经济学的经典名著不同，这套丛书都是国外大学通用的经济学教科书，大部分都已发行了几版或十几版。作者尽可能地用简明通俗的语言来阐述深奥的经济学原理，并附有案例与习题，对于初学者来说，更容易理解与掌握。

经济学是一门社会科学，许多基本原理的应用受各种不同的社会、政治或经济体制的影响，许多经济学理论是建立在一定的假设条件上的，假设条件不同，

结论也就不一定成立。因此，正确理解掌握经济分析的方法而不是生搬硬套某些不同条件下产生的结论，才是我们学习当代经济学的正确方法。

本套译丛于 1995 年春由中国人民大学出版社发起筹备并成立了由许多经济学专家学者组织的编辑委员会。中国留美经济学会的许多学者参与了原著的推荐工作。中国人民大学出版社向所有原著的出版社购买了翻译版权。北京大学、中国人民大学、复旦大学以及中国社会科学院的许多专家教授参与了翻译工作。前任策划编辑梁晶女士为本套译丛的出版做出了重要贡献，在此表示衷心的感谢。在中国经济体制转轨的历史时期，我们把这套译丛献给读者，希望为中国经济的深入改革与发展做出贡献。

《经济科学译丛》编辑委员会



前言

计量经济学高年级本科生以及刚入学的研究生认为本书的前几版在对计量经济学的理解上给予了他们很大的帮助。从销量上也可以看出,越来越多该专业的老师也认识到了这一点,所以就像通过口碑得知本书一样,学生们可能通过课程大纲学习本书;这种现象使本书前几版如此成功。

这本书的哪些部分让学生感到如此有价值呢?这本书在各个层面上补充了计量经济学教材,提供了学科回顾和概念、技巧的直观认识,避免了作为计量经济学教材必要特征的符号和技术细节的常见混乱。人们常说计量经济学教材的读者“因为一棵树而失去了整个森林”。这是不可避免的,因为那些必须要教授的术语和技术细节不允许教材去传达一种正确的直观认识:“这些都是关于什么的?”“这些是怎样结合在一起的?”所有的计量经济学教科书都没能给出这样一个综述。这不是因为缺乏尝试——大多数教科书都有相关的见解和诠释。它们对于教授者是很有意义的,但没有对学生们产生预期的影响。为什么呢?因为这些见解和诠释过于零散,散见于整本书,杂糅在技术细节里。学生们费力地记住各种符号,学习这些技术细节,却忽略了对真正理解这些细节极为重要的整体认识。这本书为学生们提供了一个更易于理解这些细节的视角。

与第五版相比,本版有很大的变化,但保留了基本结构和特色。在第1章引言之后,第2章详细讨论了选择估计量的标准;在此过程中逐步提出了很多书中将用到的计量经济学的基本概念。第3章提出了关于主题的全面评述,介绍了经典线性回归模型的五个假设,并解释了计量经济学中常常遇到的一些问题如何被

解释成对某个假设的违反。第4章解释了一些推论的概念,为以后的章节打下了基础。第5章讨论了设定一个计量经济学模型的基本方法,为后面7章的学习创建了一个平台。后面六章分别处理了违反经典线性回归模型某一假设的情况,描述它们的含义,讨论了相关的检验,并提出了针对随之产生的估计问题的解决方法。剩下的11章和附录A、B、C专注于所选的专题。附录D给出了一些练习题,附录E给出了偶数题的参考答案。难词表解释了本书主体未出现的常见计量术语。将本书作为课堂教材使用的教师可以要求从出版方拿到一套奇数题的参考答案。

本书主要的修订在于增加了两章:工具变量(第9章)和关于计算的讨论(第23章)。前者加入进来是因为工具变量应用十分广泛,并且充满争议;后者是由于计算技术的创新极大改变了高级计量经济学的面貌。两个章节简洁而直观,保留了本书特色性的技术性注释部分以给出推导细节。一些其他章节扩展了一般模型,从而提高了阐述水平。这其中最重要的是在广义矩方法(GMM)叙述当中加入了非球形误差项一章,在贝叶斯方法一章中完善了频率学派和贝叶斯学派的观点对比,在定性因变量一章中改进了多分因变量和计数数据的讨论,在有限因变量一章中补充了久期模型估计的表述,在时间序列一章中加入了小波估计,在稳健估计一章中补充了非参数估计内容。

为了尽量避免读者分心,本书没有脚注。所有参考文献、辅助要点和值得评论的细节,都归入每章之后的“一般性注释”中。书中出现的技术材料全部放在每章后面的“技术性注释”中。这些技术材料仍然按照补充而不是重复传统教科书的方式进行介绍。学生们应该能够发现,这些材料提供了一座有用的桥梁,引向在他们的主要教材中出现的更加复杂的陈述。如同之前几版一样,我尽力将非专家层次的文献列出。本书及参考文献的目的就是在读者阅读高阶文献之前,使其熟悉相关主题。

书中的错误和缺陷都是我的责任,但对于本书的改进我要感谢许多人,主要是很多研究生和本科生,因为他们的意见和反馈在第六版的修订中起到了重要的作用。一些匿名审稿人审阅了此版,他们中的很多人都提出了改进的详细建议;其中的一部分,但不是全部,得到了采纳。我还要感谢全世界所有为本书而向我致谢的学生们。我希望第六版能继续为正在做或已经完成正式课程论文的同学提供帮助。

献词

献给 Anna 和 Red。直到知道了计量经济学家是什么，他们才深刻地认识到他们的儿子可能是其中一个。怀着对 K. A. C. Manderville 的歉意，我把他们的注意力吸引到如下改编自《Lamia Gurdleneck 的毁灭》的一段话。

“你还没有告诉我，” Nuttal 女士说，“你未婚夫是从事什么职业的？”

“他是一个计量经济学家。” Lamia 回答，带着一种对处于守势的厌恶感觉。

Nuttal 女士显然有些吃惊。她还不认为计量经济学家属于正常的社会关系。这种物种，她猜测，应当以某种间接的方式被永远纪念着，就像骡子。

“但是，Sara 姨妈，这是一种很有趣的职业。” Lamia 热情地说。

“我不怀疑，”她姨妈明显非常怀疑，“把任何重要的东西仅仅用数字表示明显是不可能的，以至于关于如何做到这一点的高回报建议将有无尽的余地。但是，你不认为与一个计量经济学家一起生活会很单调吗，可以这么讲吗？”

Lamia 沉默了。她不愿讨论她在 Edward 数字化表面下所发现的令人惊异的情感潜在深度。

“重要的不是数字本身，”她终于说，“而是你怎么处理它们。”

经济科学译丛						
序号	书名	作者	Author	单价	出版年份	ISBN
1	计量经济学原理(第六版)	彼得·肯尼迪	Peter Kennedy	69.80	2014	978-7-300-19342-7
2	统计学:在经济中的应用	玛格丽特·刘易斯	Margaret Lewis	45.00	2014	978-7-300-19082-2
3	产业组织:现代理论与实践(第四版)	林恩·佩波尔等	Lynne Pepall	88.00	2014	978-7-300-19166-9
4	计量经济学导论(第三版)	詹姆斯·H·斯托克等	James H. Stock	69.00	2014	978-7-300-18467-8
5	发展经济学导论(第四版)	秋山裕	秋山裕	39.80	2014	978-7-300-19127-0
6	中级微观经济学(第六版)	杰弗里·M·佩罗夫	Jeffrey M. Perloff	89.00	2014	978-7-300-18441-8
7	平狄克《微观经济学》(第八版)学习指导	乔纳森·汉密尔顿等	Jonathan Hamilton	32.00	2014	978-7-300-18970-3
8	微观银行经济学(第二版)	哈维尔·弗雷克斯等	Xavier Freixas	48.00	2014	978-7-300-18940-6
9	施米托夫论出口贸易——国际贸易法律与实务(第11版)	克利夫·M·施米托夫等	Clive M. Schmitthoff	168.00	2014	978-7-300-18425-8
10	曼昆版《宏观经济学》习题集	南希·A·加纳科波斯等	Nancy A. Jianakoplos	32.00	2013	978-7-300-18245-2
11	微观经济学思维	玛莎·L·奥尔尼	Martha L. Olney	29.80	2013	978-7-300-17280-4
12	宏观经济学思维	玛莎·L·奥尔尼	Martha L. Olney	39.80	2013	978-7-300-17279-8
13	计量经济学原理与实践	达摩达尔·N·古扎拉蒂	Damodar N. Gujarati	49.80	2013	978-7-300-18169-1
14	现代战略分析案例集	罗伯特·M·格兰特	Robert M. Grant	48.00	2013	978-7-300-16038-2
15	高级国际贸易:理论与实证	罗伯特·C·芬斯特拉	Robert C. Feenstra	59.00	2013	978-7-300-17157-9
16	经济学简史——处理沉闷科学的巧妙方法(第二版)	E·雷·坎特伯里	E. Ray Canterbury	58.00	2013	978-7-300-17571-3
17	微观经济学(第八版)	罗伯特·S·平狄克等	Robert S. Pindyck	79.00	2013	978-7-300-17133-3
18	克鲁格曼《微观经济学(第二版)》学习手册	伊丽莎白·索耶·凯利	Elizabeth Sawyer Kelly	58.00	2013	978-7-300-17002-2
19	克鲁格曼《宏观经济学(第二版)》学习手册	伊丽莎白·索耶·凯利	Elizabeth Sawyer Kelly	36.00	2013	978-7-300-17024-4
20	管理经济学(第四版)	方博亮等	Ivan Png	80.00	2013	978-7-300-17000-8
21	微观经济学原理(第五版)	巴德·帕金	Bade, Parkin	65.00	2013	978-7-300-16930-9
22	宏观经济学原理(第五版)	巴德·帕金	Bade, Parkin	63.00	2013	978-7-300-16929-3
23	环境经济学	彼得·伯克等	Peter Berck	55.00	2013	978-7-300-16538-7
24	高级微观经济理论	杰弗里·杰里	Geoffrey A. Jehle	69.00	2012	978-7-300-16613-1
25	多恩布什《宏观经济学(第十版)》学习指导	鲁迪格·多恩布什等	Rudiger Dornbusch	29.00	2012	978-7-300-16030-6
26	高级宏观经济学导论:增长与经济周期(第二版)	彼得·伯奇·索伦森等	Peter Birch Sørensen	95.00	2012	978-7-300-15871-6
27	宏观经济学:政策与实践	弗雷德里克·S·米什金	Frederic S. Mishkin	69.00	2012	978-7-300-16443-4
28	宏观经济学(第二版)	保罗·克鲁格曼	Paul Krugman	45.00	2012	978-7-300-15029-1
29	微观经济学(第二版)	保罗·克鲁格曼	Paul Krugman	69.80	2012	978-7-300-14835-9
30	微观经济学(第十一版)	埃德温·曼斯费尔德	Edwin Mansfield	88.00	2012	978-7-300-15050-5
31	《计量经济学基础》(第五版)学生习题解答手册	达摩达尔·N·古扎拉蒂等	Damodar N. Gujarati	23.00	2012	978-7-300-15091-8
32	国际宏观经济学	罗伯特·C·芬斯特拉等	Feenstra, Taylor	64.00	2011	978-7-300-14795-6
33	卫生经济学(第六版)	舍曼·富兰德等	Sherman Folland	79.00	2011	978-7-300-14645-4
34	宏观经济学(第七版)	安德鲁·B·亚伯等	Andrew B. Abel	78.00	2011	978-7-300-14223-4
35	现代劳动经济学:理论与公共政策(第十版)	罗纳德·G·伊兰伯格等	Ronald G. Ehrenberg	69.00	2011	978-7-300-14482-5
36	宏观经济学(第七版)	N·格里高利·曼昆	N. Gregory Mankiw	65.00	2011	978-7-300-14018-6
37	环境与自然资源经济学(第八版)	汤姆·蒂滕伯格	Torn Tietenberg	69.00	2011	978-7-300-14810-0
38	宏观经济学:理论与政策(第九版)	理查德·T·弗罗恩	Richard T. Froyen	55.00	2011	978-7-300-14108-4
39	经济学原理(第四版)	威廉·博伊斯等	William Boyes	59.00	2011	978-7-300-13518-2
40	计量经济学基础(第五版)(上下册)	达摩达尔·N·古扎拉蒂	Damodar N. Gujarati	99.00	2011	978-7-300-13693-6
41	计量经济分析(第六版)(上下册)	威廉·H·格林	William H. Greene	128.00	2011	978-7-300-12779-8
42	国际经济学:理论与政策(第八版)(上册国际贸易部分)	保罗·R·克鲁格曼等	Paul R. Krugman	36.00	2011	978-7-300-13102-3

经济科学译丛						
序号	书名	作者	Author	单价	出版年份	ISBN
43	国际经济学:理论与政策(第八版)(下册 国际金融部分)	保罗·R·克鲁格曼等	Paul R. Krugman	49.00	2011	978-7-300-13101-6
44	国际贸易	罗伯特·C·芬斯特拉等	Robert C. Feenstra	49.00	2011	978-7-300-13704-9
45	经济增长(第二版)	戴维·N·韦尔	David N. Weil	63.00	2011	978-7-300-12778-1
46	投资科学	戴维·G·卢恩伯格	David G. Luenberger	58.00	2011	978-7-300-14747-5
47	宏观经济学(第十版)	鲁迪格·多恩布什等	Rudiger Dornbusch	60.00	2010	978-7-300-11528-3
48	宏观经济学(第三版)	斯蒂芬·D·威廉森	Stephen D. Williamson	65.00	2010	978-7-300-11133-9
49	计量经济学导论(第四版)	杰弗里·M·伍德里奇	Jeffrey M. Wooldridge	95.00	2010	978-7-300-12319-6
50	货币金融学(第九版)	弗雷德里克·S·米什金等	Frederic S. Mishkin	79.00	2010	978-7-300-12926-6
51	金融学(第二版)	兹维·博迪等	Zvi Bodie	59.00	2010	978-7-300-11134-6
52	国际经济学(第三版)	W·查尔斯·索耶等	W. Charles Sawyer	58.00	2010	978-7-300-12150-5
53	博弈论	朱·弗登博格等	Drew Fudenberg	68.00	2010	978-7-300-11785-0
54	投资学精要(第七版)(上下册)	兹维·博迪等	Zvi Bodie	99.00	2010	978-7-300-12417-9
55	财政学(第八版)	哈维·S·罗森等	Harvey S. Rosen	63.00	2009	978-7-300-11092-9
56	社会问题经济学(第十八版)	安塞尔·M·夏普等	Ansel M. Sharp	45.00	2009	978-7-300-10995-4
经济科学译库						
序号	书名	作者	Author	单价	出版年份	ISBN
1	克鲁格曼经济学原理(第二版)	保罗·克鲁格曼等	Paul Krugman	65.00	2013	978-7-300-17409-9
2	国际经济学(第13版)	罗伯特·J·凯伯等	Robert J. Carbaugh	68.00	2013	978-7-300-16931-6
3	货币政策:目标、机构、策略和工具	彼得·博芬格	Peter Bofinger	55.00	2013	978-7-300-17166-1
4	MBA 微观经济学(第二版)	理查德·B·麦肯齐等	Richard B. McKenzie	55.00	2013	978-7-300-17003-9
5	激励理论:动机与信息经济学	唐纳德·E·坎贝尔	Donald E. Campbell	69.80	2013	978-7-300-17025-1
6	微观经济学:价格理论观点(第八版)	斯蒂文·E·兰德斯博格	Steven E. Landsburg	78.00	2013	978-7-300-15885-3
7	经济数学与金融数学	迈克尔·哈里森等	Michael Harrison	65.00	2012	978-7-300-16689-6
8	策略博弈(第三版)	阿维纳什·迪克西特等	Avinash Dixit	72.00	2012	978-7-300-16033-7
9	高级宏观经济学基础	本·J·海德拉等	Ben J. Heijdra	78.00	2012	978-7-300-14836-6
10	行为经济学	尼克·威尔金森	Nick Wilkinson	58.00	2012	978-7-300-16150-1
11	金融风险经理考试手册(第六版)	菲利普·乔瑞	Philippe Jorion	168.00	2012	978-7-300-14837-3
12	服务经济学	简·欧文·詹森	Jan Owen Jansson	42.00	2012	978-7-300-15886-0
13	统计学:在经济和管理中的应用(第八版)	杰拉德·凯勒	Gerald Keller	98.00	2012	978-7-300-16609-4
14	面板数据分析(第二版)	萧政	Cheng Hsiao	45.00	2012	978-7-300-16708-4
15	中级微观经济学:理论与应用(第10版)	沃尔特·尼科尔森等	Walter Nicholson	85.00	2012	978-7-300-16400-7
16	经济学中的数学	卡尔·P·西蒙等	Carl P. Simon	65.00	2012	978-7-300-16449-6
17	社会网络分析:方法与应用	斯坦利·沃瑟曼等	Stanley Wasserman	78.00	2012	978-7-300-15030-7
18	用 Stata 学计量经济学	克里斯托弗·F·鲍姆	Christopher F. Baum	65.00	2012	978-7-300-16293-5
19	美国经济史(第10版)	加里·沃尔顿等	Gary M. Walton	78.00	2011	978-7-300-14529-7
20	增长经济学	菲利普·阿格因	Philippe Aghion	58.00	2011	978-7-300-14208-1
21	经济地理学:区域和国家一体化	皮埃尔·菲利普·库姆斯等	Pierre-Philippe Combes	42.00	2011	978-7-300-13702-5
22	社会与经济网络	马修·O·杰克逊	Matthew O. Jackson	58.00	2011	978-7-300-13707-0
23	环境经济学	查尔斯·D·科尔斯塔德	Charles D. Kolstad	53.00	2011	978-7-300-13173-3
24	空间经济学——城市、区域与国际贸易	保罗·克鲁格曼等	Paul Krugman	42.00	2011	978-7-300-13037-8

经济科学译库						
序号	书名	作者	Author	单价	出版年份	ISBN
25	国际贸易理论:对偶和一般均衡方法	阿维纳什·迪克西特等	Avinash Dixit	45.00	2011	978-7-300-13098-9
26	契约经济学:理论和应用	埃里克·布鲁索等	Eric Brousseau	68.00	2011	978-7-300-13223-5
27	反垄断与管制经济学(第四版)	W·基普·维斯科斯等	W. Kip Viscusi	89.00	2010	978-7-300-12615-9
28	拍卖理论	维佳·克里斯纳等	Vijay Krishna	42.00	2010	978-7-300-12664-7
29	计量经济学指南(第五版)	皮特·肯尼迪	Peter Kennedy	65.00	2010	978-7-300-12333-2
30	管理者宏观经济学	迈克尔·K·伊万斯等	Michael K. Evans	68.00	2010	978-7-300-12262-5
31	利息与价格——货币政策理论基础	迈克尔·伍德福德	Michael Woodford	68.00	2010	978-7-300-11661-7
32	理解资本主义:竞争、统制与变革(第三版)	塞缪尔·鲍尔斯等	Samuel Bowles	66.00	2010	978-7-300-11596-2
33	递归宏观理论(第二版)	萨金特等	Thomas J. Sargent	79.00	2010	978-7-300-11595-5
34	剑桥美国经济史(第一卷):殖民地时期	斯坦利·L·恩格尔曼等	Stanley L. Engerman	48.00	2008	978-7-300-08254-7
35	剑桥美国经济史(第二卷):漫长的19世纪	斯坦利·L·恩格尔曼等	Stanley L. Engerman	88.00	2008	978-7-300-09394-9
36	剑桥美国经济史(第三卷):20世纪	斯坦利·L·恩格尔曼等	Stanley L. Engerman	98.00	2008	978-7-300-09395-6
37	横截面与面板数据的经济计量分析	J. M. 伍德里奇	Jeffrey M. Wooldridge	68.00	2007	978-7-300-08090-1
金融学译丛						
序号	书名	作者	Author	单价	出版年份	ISBN
1	国际金融市场导论(第六版)	斯蒂芬·瓦尔德斯等	Stephen Valdez		2014	978-7-300-18896-6
2	金融数学:金融工程引论(第二版)	马雷克·凯宾斯基等	Marek Capinski	42.00	2014	978-7-300-17650-5
3	财务管理(第二版)	雷蒙德·布鲁克斯	Raymond Brooks	69.00	2014	978-7-300-19085-3
4	期货与期权市场导论(第七版)	约翰·C·赫尔	John C. Hull	69.00	2014	978-7-300-18994-2
5	固定收益证券手册(第七版)	弗兰克·J·法博齐	Frank J. Fabozzi	188.00	2014	978-7-300-17001-5
6	国际金融:理论与实务	皮特·塞尔居	Piet Sercu	88.00	2014	978-7-300-18413-5
7	金融市场与金融机构(第7版)	弗雷德里克·S·米什金 斯坦利·G·埃金斯	Frederic S. Mishkin Stanley G. Eakins	79.00	2013	978-7-300-18129-5
8	货币、银行和金融体系	R·格伦·哈伯德等	R. Glenn Hubbard	75.00	2013	978-7-300-17856-1
9	并购创造价值(第二版)	萨德·苏达斯纳	Sudi Sudarsanam	89.00	2013	978-7-300-17473-0
10	个人理财——理财技能培养方法(第三版)	杰克·R·卡普尔等	Jack R. Kapoor	66.00	2013	978-7-300-16687-2
11	国际财务管理	吉尔特·贝卡特	Geert Bekaert	95.00	2012	978-7-300-16031-3
12	金融理论与公司政策(第四版)	托马斯·科普兰等	Thomas Copeland	69.00	2012	978-7-300-15822-8
13	应用公司财务(第三版)	阿斯沃思·达摩达兰	Aswath Damodaran	88.00	2012	978-7-300-16034-4
14	资本市场:机构与工具(第四版)	弗兰克·J·法博齐	Frank J. Fabozzi	85.00	2011	978-7-300-13828-2
15	衍生品市场(第二版)	罗伯特·L·麦克唐纳	Robert L. McDonald	98.00	2011	978-7-300-13130-6
16	债券市场:分析与策略(第七版)	弗兰克·J·法博齐	Frank J. Fabozzi	89.00	2011	978-7-300-13081-1
17	跨国金融原理(第三版)	迈克尔·H·莫非特等	Michael H. Moffett	78.00	2011	978-7-300-12781-1
18	风险管理与保险原理(第十版)	乔治·E·瑞达	George E. Rejda	95.00	2010	978-7-300-12739-2
19	兼并、收购和公司重组(第四版)	帕特里克·A·高根	Patrick A. Gaughan	69.00	2010	978-7-300-12465-0
20	个人理财(第四版)	阿瑟·J·基翁	Athur J. Keown	79.00	2010	978-7-300-11787-4
21	统计与金融	戴维·鲁珀特	David Ruppert	48.00	2010	978-7-300-11547-4
22	国际投资(第六版)	布鲁诺·索尔尼克等	Bruno Solnik	62.00	2010	978-7-300-11289-3
23	财务报表分析(第三版)	马丁·弗里德森	Martin Fridson	35.00	2010	978-7-300-11290-9

Guide to Econometrics, 6e
by Peter Kennedy

Copyright © 2008 by Peter Kennedy

All Rights Reserved. Authorised translation from the English language edition published by Blackwell Publishing Limited. Responsibility for the accuracy of the translation rests solely with China Renmin University Press and is not the responsibility of Blackwell Publishing Limited. No part of this book may be reproduced in any form without the written permission of the original copyright holder, Blackwell Publishing Limited.

Simplified Chinese version © 2014 by China Renmin University Press.

目 录

第 1 章 引言	1
1.1 什么是计量经济学	1
1.2 干扰项	2
1.3 估计和估计量	3
1.4 良好和首选的估计量	4
一般性注释	5
技术性注释	10
第 2 章 估计量标准	11
2.1 引言	11
2.2 计算成本	12
2.3 最小二乘	12
2.4 R^2 最大	13
2.5 无偏性	14
2.6 有效性	15
2.7 均方误差 (MSE)	17
2.8 渐近性	18
2.9 最大似然	20
2.10 蒙特卡洛研究	21

2.11 总结	23
一般性注释	24
技术性注释	32
第3章 经典线性回归模型	41
3.1 作为一览表的教科书	41
3.2 五个假设	42
3.3 CLR 模型中的 OLS 估计量	43
一般性注释	45
技术性注释	48
第4章 区间估计和假设检验	53
4.1 引言	53
4.2 单一假设的检验: t 检验	54
4.3 联合假设的检验: F 检验	54
4.4 参数向量的区间估计	55
4.5 LR, W 和 LM 统计量	58
4.6 自举法	59
一般性注释	60
技术性注释	69
第5章 设定	73
5.1 引言	73
5.2 三种方法	74
5.3 设定的一般原理	77
5.4 错误设定检验/诊断	77
5.5 再说 R^2	80
一般性注释	81
技术性注释	91
第6章 违反假设一: 错误回归元, 非线性和参数非常数	95
6.1 引言	95
6.2 错误的自变量集	95
6.3 非线性	97
6.4 变化的参数值	99
一般性注释	101
技术性注释	108
第7章 违反假设二: 干扰项的期望非零	112
不变的非零均值	112

零截距	113
有限因变量	113
边界生产函数	113
对数变换	114
一般性注释	114
第 8 章 违反假设三：非球状干扰项	115
8.1 引言	115
8.2 违背的后果	116
8.3 异方差	117
8.4 自相关干扰项	120
8.5 广义矩法	123
一般性注释	124
技术性注释	131
第 9 章 违反假设四：工具变量	139
9.1 引言	139
9.2 IV 估计量	142
9.3 IV 方法的问题	144
一般性注释	147
技术性注释	151
第 10 章 违反假设五：测量误差和自回归	157
10.1 变量中的误差	157
10.2 自回归	160
一般性注释	162
技术性注释	165
第 11 章 违反假设六：联立方程	170
11.1 引言	170
11.2 识别	171
11.3 单方程方法	174
11.4 系统方法	177
一般性注释	178
技术性注释	183
第 12 章 违反假设七：多重共线性	189
12.1 引言	189
12.2 后果	190
12.3 检测多重共线性	192
12.4 对策	192

一般性注释	194
技术性注释	198
第 13 章 引入外部信息	199
13.1 引言	199
13.2 确定约束条件	200
13.3 随机约束条件	200
13.4 预检验估计量	200
13.5 外部信息与 MSE	201
一般性注释	203
技术性注释	207
第 14 章 贝叶斯方法	209
14.1 引言	209
14.2 什么是贝叶斯分析	210
14.3 贝叶斯方法的优点	212
14.4 克服实践者的怨言	213
一般性注释	215
技术性注释	221
第 15 章 虚拟变量	228
15.1 引言	228
15.2 解释	229
15.3 加入其他定性变量	230
15.4 与定量变量的相互影响	231
15.5 特定观测值虚拟变量	232
一般性注释	233
技术性注释	236
第 16 章 定性因变量	237
16.1 二分因变量	237
16.2 多分因变量	239
16.3 有序 logit/probit 模型	240
16.4 计数	241
一般性注释	241
技术性注释	250
第 17 章 有限因变量	258
17.1 引言	258
17.2 Tobit 模型	259