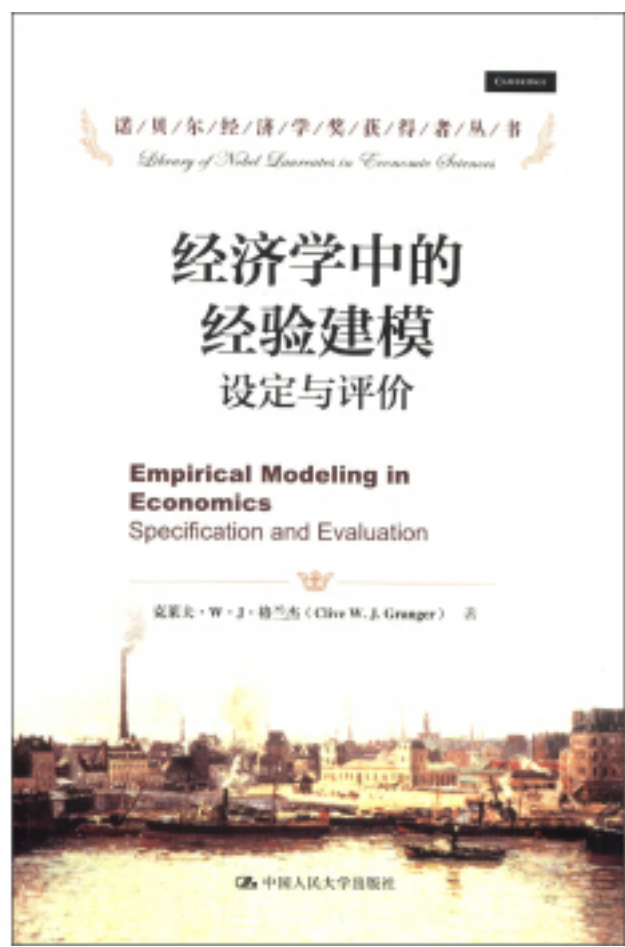


诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价 [Empirical Modeling in Economics:Specification and Evaluation]



[诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价 \[Empirical Modeling in Economics:Specification and Evaluation\]](#) [下载链接1](#)

著者:[英] 克莱夫·W·J·格兰杰 (Clive W.J.Granger) 著，洪福海 译

[诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价 \[Empirical Modeling in Economics:Specification and Evaluation\]](#) [下载链接1](#)

标签

评论

啦啦啦啦，怎么说呢，书只要100来页。相信浓缩的都是精华吧？

经济学的建模前提假设参数选取事后评价三项关键性因素，除去参数选择很大程度上依赖于前提假设和评价，作者是这个领域的大师，值得看

好评好评好评好评好评好评好评好评

部门藏书 经典诺奖

好书。。。。。。。。。。

很好 很实惠 京东活动一如既往强大

诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价

一定要写评价很烦

抢券购买的，还不错，收着有时间看

蛮好的，家里人很喜欢的说。真好想要看的

好好好好好好好好有意思

好书，就是封面太软。

质量挺好的，内容也还可以

不错很不错哈哈哈哈哈

京东的物流非常给力，书也不错

写的不错，值得购买，是学术科研的参考书籍

诺贝尔啊，看了一下还行吧

丛书不错，收藏

不错不错，还行，还行

折价购得不错的一本书。

薄薄的一册子，挺好吧

一如既往的好，买的都知道。

很好很经典的书

书中广泛借鉴和引用了来自经济学、金融学、政治学和环境经济学，乃至艺术、文学和娱乐业的案例和小品，将精确性与累积的直觉融为一体，从而就这个主题提供了独特且十分有趣的见解。

非常满意，五星

的观点就是：美国在最开始，经济很不平等；上个世纪五六十年代经济开始相对平等；到七八十年代又开始极端不平等。直到奥巴马为代表的民主党人赢得竞选。而经济的不平等主要是由政治决定的。因为之前民主党人右倾，而共和党人左倾，后来则又各自为政，其原因是美国的原罪——种族歧视。尼克松总统为过渡人物，其后里根总统开始减税（问题是减了谁的税）。小布什利用恐怖主义和伊拉克战争赢得选票。悬而未决的是全民医疗福利。并将美国与法国做出对比。由此可见，还是欧洲最好，安全舒适自由。只是富人过得没那么好，是懒人的天堂吧。

所以，综上，作者认为，经济不平等就是政治的原因（这个我完全同意），只因为在当今的社会，如果不是瞎子，对比十几年前和现在，就很能感觉到这一点了。所以我觉得这本书其实就是一本宣传民主党的书吧？因为经济不平等、医疗神马的也不好，都是因为政治的原因。那么我们大众就选择共和党了好不啦？这样大家都开心啦，平等了好不啦？

当然这本书也加深了我对于美国两党的一些认识，此前我一无所知。另外此前我也很困惑于为何经济市场化后的经济发展规律仍然会受到政策的很大影响？因为本来一直就受到很大影响的好不啦。从这本书中我找到了答案。

因此更加坚定了不要轻易踏足股市的决心。本来看了两本价值投资的书，就觉得自己心飘飘然也，似乎就能在股市风生水起。实际上不是。那么多人都是搞经济的，人家比你聪明，学的比你多，研究的比你深入，凭什么不比你挣钱多呢？何况，你所看到的这个股市，风云诡谲，很多东西，你根本看不出来。看完这本书后，我更加确信了这个看法。毕竟，对于很多政策性的东西，我们这样外行的人根本就跟不上外界的讯息的。由此，个人的成长与投资就显得尤为重要。只是以前几千块钱用来准备去股市上小试牛刀，现在则倾向于用来买书和学习，上各种自我提升的课程班。

另外我有个疑惑的地方就是，什么是“自由派”，什么是“保守派”？在以后的读书中，相信会解决这个困惑的。译者将“Liberal”翻译成了“自由主义者”，实在是费解。后面书中又说作者是自由派，即民主党人“自由派”（更倾向于平等，不是什么效益主义，如约翰密尔之类）——主要是读些自由主义的书。

此外，实在是写不出什么有价值的书评了。因为知识积淀还很不够。看了牛人们的书评后，感受就是要再读书。

很好!

好

出版社: 中国人民大学出版社; 第1版 (2005年9月1日) 丛书名:

当代世界学术名著经济学系列 平装: 83页 开本: 16开 ISBN: 7300065767 条形码:

9787300065762 尺寸: 23.4 x 15.5 x 0.5 cm 重量: 222 g

编辑本段作者简介作者: (美国) 克莱夫·W·J·格兰杰 克莱夫·格兰杰 (Clive Granger), 1934年生于英国威尔士的斯旺西, 现为英国公民。他于1959年获得英国诺丁汉大学博士学位, 现为美国加利福尼亚大学圣迭戈分校的荣誉经济学教授, 并担任该校经济学秘书协会主席。他于1995年当选为美国艺术与科学院院士, 并于2003年获诺贝尔经济学奖。格兰杰是目前全球最杰出的计量经济学家之一, 他在学

术界的建树几乎包括了近40年来计量经济学在时间序列方面, 的所有重大发展。经济时间序列时, 格兰杰和另一位学者汉塔纳卡 (Hatanaka) 首创使用了谱分析方法 (spectral analysis), 并与著名学者摩根斯坦 (Oscar

Morgenstern) 一起对纽约股票市场的股票价格进行了相关分析。在预测研究

上, 他在1959年发表的论文《关于潮汐河流泛洪的概率估

计》被认为是现代成本—收益分析教材的范本案例。在菲线性问题的研究上, 他和焦克斯 (R. Joyeux) 于1980年发表的论文《长期记忆时间序列模型与分数差分法简介》对长期记忆理论做出了很大贡献。所

编辑本段内容简介在本书中, 格兰杰阐明了构建和评估经验模型的过程。书中广泛借鉴和引用了来自经济学、金融学、政治学和环境经济学, 乃至艺术、文学和娱乐业的案例和小品, 将精确性与累积的直觉融为一体, 从而就这个主题为我们提供了独特且十分有趣的见解。

本书的第一章分析模型的设定问题, 以巴西亚马孙流域的森林垦伐为例, 讨论了模型的设定过程。第二章考虑评价问题, 指出了经济学家们对于评价的忽视, 以及应该以模型的结果的质量为准绳来评价模型。第三章使用比前两章更为复杂和技术化的方法, 进一步讨论如何评价预测的问题。

本书给我们带来了关于怎样构建和评价模型的新思想, 即我们在今后的建模中应当更多的考虑模型的经济意义上的显著性而非统计意义上的显著性, 更多的考虑模型的使用价值而非其本身的华丽性。编辑本段媒体评论书评

对于经济模型的构建, 首先要考虑模型与经济理论的整合性, 如果模型在统计上很有意义, 而在经济上不具有合理性的话, 那么模型对于经济的分析就没有多少参考价值。书中案例包罗万象, 简单有趣, 非专业人士, 亦能理解经济模型的构建过程, 从中获益匪浅。——赵国庆中国人民大学教授、博士生导师

当我们比较数理经济学和计量经济学时, 总是觉得前者像科学, 而后者更像一门艺术。确实如此。一项经验研究从计量模型的选取和设定开始, 一直到模型的估计、模型的评价、预测和解释等等都由研究者“说了算”。因此, 经验研究给人的感觉是不可信的, 研究者可以找到“合适”的模型来支持所要的经济理论观点。但是, 格兰杰在本书中 通过一些有趣的真实例子

非常严谨地阐述了构建经验模型的整个过程。让我们看到了经验研究的科学性、可信性和趣味性。——陈彦斌经济学博士 编辑本段目录第1章 经验模型的设定

模型与变化 亚马孙工程 建模 模型设定的深层 问题 向前看、向后看 参考文献 第2章

经验模型的评价 一般的讨论 经济学中的评价 检验霍尔的消费理论 预测与金融中的评价 政策模型的评价 一些结论 参考文献 第3章 再论对计量经济模型与预测的评价 本章体例

1 INF经验模型的意义何在? 1 FOR 计量经济模型 2 INF对使用二次成本的预测的评价 2

ROR对预测的评价——出发点 3 INF使用一般的成本函数 3

ROR一般化成本函数情形下的评价 4 INF使用者与成本函数 4 FOR

不同的使用者有着不同的成本函数 5 INF预测的来源 5 FOR 预测从哪里来? 6
INF比较分布 6 FOR比较预测分布 7 INF一个例子 7 FOR一个简单的例子 8 INF
检验与估计 8 FOR 经验意义 9 计量经济模型

经济学中的模型构建与分析过程大致分为四个环节——设定、建模、参数估计与检验、模型评价。设定过程是对模型中需要具体包括的因素的选择、取舍过程，同时也是对模型遵循的大致函数形式的选择过程；建模是对模型的具体形式的判断、分析过程；参数估计与检验是在一定标准下（如均方误差最小），根据一定的数据（如横截面数据、时间序列数据、面板数据等）估计出函数中包含的参数，并对估计结果进行假设检验的不断取舍、反复递进的过程；评价是对构建起的模型结果（模型的可信度、敏感度、预测能力、对真实经济情景的适用性等）进行总的检验与评价的过程。众所周知，计量经济学是以数学、统计学、经济学等众多学科为基础的交叉学科。在数学与统计学提供的强大工具的支持下，经过计量经济学家们近一个世纪的努力，第二个和第三个环节的研究已经相对成熟、颇具规模，而经济学家们本来相对擅长的设定与评价反而成了薄弱环节。格兰杰教授对经济学研究的一大杰出贡献是，发现多个非稳定时间序列的特别组合可以呈现出稳定性，从而可以得出正确的统计推理。他称之为某种“共合体”现象，并提出了根据共同趋势进行经济时间序列分析的方式。瑞典皇家科学院说：“格兰杰的发现对研究财富与消费、汇率与价格以及短期利率与长期利率之间的关系具有非常重要的意义。”

格兰杰教授的成果来自于他长期严密的思考和深邃的思想，正所谓“问渠哪得清如许？为有源头活水来”。他在讲稿中坦诚告诉读者成功的“活水”所在，而不仅限于展示对一个具体模型的构建与分析的过程。这种“授人以鱼，未若授人以渔”的作风本身就堪称学人的典范。计量经济学协会在首期《计量经济学》（Econometrica）中讲到：“…其主要目的应该是促进有助于理论数量方法与实证数量方法相统一的研究，促进富有建设性的严格的思考的研究，类似的思考已经主导了自然科学研究”。格兰杰教授不但以身作则地做到了这一点，而且有所发挥和推进，他指出：“多数经济研究不应该被视为纯粹的数学，而应该与一个纯粹的、表述确切的目标相联系”，“理论经济学家与应用经济学家之间需要必要的沟通，而架构于经济理论与应用经济学家之间的桥梁必须有一个坚实的结构，从而使得经济学家们能够安全地往返于两岸。”格兰杰教授没有用复杂的模型和高深的语言来讲述自己的理论，而是用简单的式子、幽默的语言和通俗的事例加以阐述。一个成熟的理论，即使是很艰深和复杂的，被一个洞若观火的智者阐述的时候也总能让人感觉到通俗易懂、妙趣横生。格兰杰教授的讲述使不从事实证研究的人，亦能领略实证分析的魅力。如同在生活中，多数人并不懂移动通讯原理，却能熟练运用手机的功能；并不懂软件产品的设计原理，却能很好地享受计算机软件带来的高效、便捷。他广泛借鉴了来自经济学、金融学、政治学和环境经济学，乃至艺术、文学、生活和娱乐业的案例和小品，将精确性与直觉融为一体，将理论渗透到生活之中，让我们轻松领略一个深邃的道理。

正如作者所言，现在很多的经验模型，都是为了模型而去建模；外表看上去很华丽，各种统计检验也都通过，但是对于经济现象的解释能力却很差，只是“看上去很美”。侧重理论建模的学者，拼命地要去解释随机误差项的理论含义；偏重实际的学者，对于理论不是很热衷；大部分的人采用了“折衷”的办法，在理论建模后，根据实际情况不断修正。只是这样的模型究竟有多少解释的意义？还是只为了得出一个早就了然的结论？在A、B两个模型比较谁“更优”的问题上，作者认为可以把A与B组合起来，看是否效果更好——这一点很有启发。

[诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价 \[Empirical Modeling in Economics: Specification and Evaluation\]](#) [下载链接1](#)

书评

[诺贝尔经济学奖获得者丛书·经济学中的经验建模：设定与评价 \[Empirical Modeling in Economics:Specification and Evaluation\]](#)[下载链接1](#)