

中级计量经济学

一、课程编码：

课内学时： 48 学分： 3

二、适用专业：应用经济学，企业管理，管理科学与工程等

三、先修课程：微积分，线性代数，概率论与数理统计，微观经济学，宏观经济学

四、教学目标

1. 了解现代经济学的特征，了解经济数量分析课程在经济学课程体系中的地位，了解经济数量分析在经济学科的发展和实际经济工作中的作用；
2. 进一步掌握经济计量经济学的中级理论与方法，了解计量经济学理论与方法和拓展新发展；
3. 能够建立并应用计量经济模型，对现实经济现象中的数量关系进行深入分析；
4. 形成在经济学领域熟练应用高等计量经济学工具进行方法研究、数学建模和科学研究的能力，并为进一步学习高级计量课程打下基础。

五、教学方式：

课堂讲授，材料自学与课堂讨论，穿插案例分析，软件建模学习，撰写计量经济学应用论文。

六、主要内容及学时分配

1. 中级计量经济学概述与经典线性计量经济学模型理论方法回顾 4 学时
 - 1.1 计量经济学的基本概述
 - 1.2 计量经济学的内容体系
 - 1.3 建立与应用计量经济模型的主要步骤
 - 1.4 经典线性计量经济学模型理论方法回顾
2. 多元回归模型 4 学时
 - 2.1 多元回归模型的估计、检验、预测
 - 2.2 多元回归模型的计算过程与案例分析
 - 2.3 异方差性专题
 - 2.4 自相关性专题
 - 2.5 多重共线性专题
 - 2.6 非线性回归模型专题
3. EVIEWS 软件专题 4 学时
 - 3.1 计量经济学应用软件概述
 - 3.2 EVIEWS 操作解析
 - 3.3 EVIEWS 编程与模型技巧
 - 3.4 基于案例的 EVIEWS 应用概述
4. 单方程回归真模型的几个专题 3 学时
 - 4.1 模型中的特殊解释变量概述
 - 4.2 随机解释变量
 - 4.3 滞后变量

- 4.4 虚拟变量
- 4.5 时间变量
- 5. 联立方程模型的估计与模拟 6 学时
 - 5.1 联立方程模型分类
 - 5.2 联立方程模型的识别概念
 - 5.3 联立方程模型的识别条件
 - 5.4 联立方程模型的估计
- 案例学习
- 6. 几种典型的计量经济模型应用 3 学时
 - 6.1 需求函数模型
 - 6.2 消费函数模型
 - 6.3 生产函数模型
 - 6.4 投资函数模型
 - 6.5 宏观计量经济模型的构建方法
 - 6.6 计量经济模型的评价与应用
- 7. 时间序列模型 6 学时
 - 7.1 时间序列定义与分类
 - 7.2 自相关函数
 - 7.3 偏自相关函数
 - 7.4 时间序列模型的建立与预测
- 案例分析
- 8. 非平稳经济变量与协整 6 学时
 - 8.1 非平稳时间序列与虚假回归
 - 8.2 单位根检验
 - 8.3 经济变量的协整性
 - 8.4 误差修正模型
- 9. 向量自回归和向量误差修正模型 6 学时
 - 9.1 向量自回归理论
 - 9.2 VAR 模型的检验
 - 9.3 脉冲响应与方差分解
 - 9.4 计量经济学前沿理论进展综述 6 学时

教师在教学过程中可根据教学情况在教学内容与学时分配方面作适当的调整。

七、考核与成绩评定

最后成绩中笔试部分成绩占 60%，平时成绩及作业占 40%。

八、参考书及学生必读参考资料

1. 张晓峒. 计量经济学基础第三版[M], 天津:南开大学出版社
2. Wooldridge, J.M., Introductory Econometrics, 5th Edition, South-Western College Publishing, 2012.
3. 张晓峒. 计量经济学软件 EViews 使用指南[M], 北京:机械工业出版社

4.高铁梅.计量经济分析方法与建模[M].北京:清华大学出版社

5.Damona N. Gujarati. Basic Econometrics[M]. McGraw Hill, 2004

6.张晓峒. 应用数量经济学[M]. 北京:机械工业出版社

九、大纲撰写人：赵中秋 张凌翔