**北京大学国家发展研究院**

**中级计量经济学 (本科生)**

**2018年春季**

 任课教师： 沈 艳

上课时间： 周一， 15: 10 － 17: 00 地点 ： 二教314

周二， 08: 00 － 09: 50（单）

答疑时间： 周三， 10: 10 － 12: 00或预约 办公室 ： 国家发展研究院605室

电话 ： 62767418 email ： yshen@nsd.pku.edu.cn

助教 ：

习题课时间：周二，08: 00 － 09: 50（双） 习题课地点：二教314

**注：请认真阅读本大纲再决定是否选课。**

**先修课**

中级微观经济学、中级宏观经济学、概率统计

**教材**

必备: Wooldridge, 计量经济学导论:现代观点(第6版)(清华经济学系列英文版教材)， 清华大学出版社，2017年4月。

**课程简介**

本课程介绍计量经济学的基本理论和方法, 旨在培养使用相应理论与方法进行实证研究的能力。本课程侧重介绍横截面数据的多元线性回归、模型设定、假设检验的理论和实际运用。 要求同学不仅掌握计量经济学相关理论, 并在课程结束时能使用STATA等软件展开实证分析。

**要求**

1. 课程考核由课堂参与（10%）、笔头作业（20％）、1次期中考试（20%）和1次期末考试（50%）组成。期末综合成绩按照上述权重加总计算得到。
2. 作业共四次，每次作业占5%的总成绩。作业需在截止日期**上课前**交给助教。迟交作业当次成绩按零分计。如果对作业批改存在疑义，可在拿到作业一周内申诉。作业发放日期与上交日期见课程安排表。
3. 鼓励同学完成作业时互相讨论。若发现抄袭，抄袭者和被抄袭者当次作业计零分。
4. 考试方式为闭卷考试，试卷语言为英文，答题中英文皆可。期中考试日期为**2018年4月16日**，期末考试为**2018年6月25日**。
5. 期中、期末缺考则当次考试成绩计零分，无补考。
6. 修课期间如需要请假，请直接与双学位办公室沟通。
7. 贿赂老师、助教者一经发现，将由双学位办公室处理。老师保留永久拒绝学生重修的权利。

**课程安排：**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 周 次 | 课 次 | 日期 | 课程内容 | 作 业 |
| 一 | 1 | 2月26 日 | 课程内容介绍与复习 |  |
| 一 | 2 | 2月27日 | 简单回归模型(1)，2.1 – 2.3 |  |
| 二 | 3 | 3月 5日 | 简单回归模型(2), 2.4 – 2.6 |  |
| 三 | 4 | 3月 12日 | 多元回归模型的估计(1), 3.1 – 3.2 | 作业（1） |
| 三 | 5 | 3月 13日 | 多元回归模型的估计(2), 3.3 – 3.4 |  |
| 四 | 6 | 3月 19日 | 多元回归模型的估计(3), 3.4 – 3.5 | **作业（1）上交** |
| 五  五 | 7  8 | 3月 26日  3月 27日 | 多元回归模型的推断(1), 4.1 – 4.2  多元回归模型的推断(2), 4.3 – 4.4 |  |
| 六 | 9 | 4月2日 | 多元回归模型的推断(3), 4.5 – 4.6 | 作业（2） |
| 七 | 10 | 4月9日 | 多元回归模型的大样本特性(1) 5.1 |  |
| 七 | 11 | 4月 10日 | 多元回归模型的大样本特性(2) 5.2 | **作业（2）上交** |
| 八 | 12 | 4月 16**日** | **期中考试** |  |
| 九  九 | 13  14 | 4月23日  4月24日 | 多元回归模型的其它问题: 数据和模型的形式, 6.1 – 6.2  多元回归模型的其它问题：拟合优度和变量选择, 6.3,预测和残差分析, 6.4 |  |
| 十  十一 | 15  16 | 4月 30日  5月7日 | 多元回归模型的其它问题: 虚拟变量 (1), 7.1-7.3  多元回归模型的其它问题: 虚拟变量（2），7.4-7.5 | 作业（3） |
| 十一 | 17 | 5月 8日 | 多元回归模型的其它问题: 虚拟变量（3），17.1 |  |
| 十二 | 18 | 5月14日 | 多元回归模型的一般化: 异方差 （1） 8.1 – 8.2 | **作业（3）上交** |
| 十三  十三 | 19  20 | 5月 21日  5月22日 | 多元回归模型的一般化: 异方差 （2） 8.3 – 8.4  多元回归模型的一般化: 自相关 （1）12.1-12.2 |  |
| 十四  十五 | 21  22 | 5月 28日  6月4日 | 多元回归模型的一般化: 模型设定 9.1-9.4  工具变量（1） 15.1 – 15.2 | 作业（4） |
| 十五  十六 | 23  24 | 6月5日  6月 11日 | 工具变量（2） 15.3 – 15.4  如何做实证研究 | **作业（4）上交** |
|  |  | 6月25日 | **期末考试** |  |