

北京大学国家发展研究院

中级计量经济学 (双学位)

2017 年春季

任课教师： 沈 艳

上课时间： 周三， 17: 40 — 19: 30

周四， 17:40 — 19: 30

答疑时间： 周三， 10: 10 — 12: 00 或预约

电话 : 62767418

助教 :

地点 : 二教 207

办公室 : 国家发展研究院 605 室

email : yshen@nsd.pku.edu.cn

习题课时间：周四，19:40 — 21: 30

习题课地点：二教 307

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 5 版)(清华经济学系列英文版教材), 清华大学出版社, 2014 年 1 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 **2017 年 4 月 6 日**, 期末考试为 **2017 年 5 月 31 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	日期	课程内容	作业
第一周	2月22日	0 课程内容介绍	
	2月23日	1 简单回归模型(1), 2.1 - 2.2	
第二周	3月1日	2 简单回归模型(2), 2.3 - 2.4	
	3月2日	3 简单回归模型(3), 2.5 - 2.6	作业(1)
第三周	3月8日	4 多元回归模型的估计(1), 3.1 - 3.2	
	3月9日	5 多元回归模型的估计(2), 3.3 - 3.4	作业(1) 上交
第四周	3月15日	6 多元回归模型的估计(3), 3.4 - 3.5	
	3月16日	7 多元回归模型的推断(1), 4.1 - 4.2	
第五周	3月22日	8 多元回归模型的推断(2), 4.3 - 4.4	
	3月23日	9 多元回归模型的推断(3), 4.5 - 4.6	作业(2)
第六周	3月29日	10 多元回归模型的大样本特性(1) 5.1	
	3月30日	11 多元回归模型的大样本特性(2) 5.2	作业(2) 上交
第七周	4月5日	期中复习	
	4月6日	期中考试	
第八周	4月12日	12 多元回归模型的其他问题: 数据和模型的形式, 6.1 - 6.2	
	4月13日	13 多元回归模型的其他问题: 拟合优度和变量选择, 6.3, 预测和残差分析, 6.4	
第九周	4月19日	14 多元回归模型的其他问题: 虚拟变量(1), 7.1-7.3	
	4月20日	15 多元回归模型的其他问题: 虚拟变量(2), 7.4-7.5	作业(3)
第十周	4月26日	16 多元回归模型的其他问题: 虚拟变量(3), 17.1	
	4月27日	17 多元回归模型的一般化: 异方差(1) 8.1 - 8.2	作业(3) 上交
第十一周	5月3日	18 多元回归模型的一般化: 异方差(2) 8.3 - 8.4	
	5月4日	19 多元回归模型的一般化: 模型设定(1) 9.1 - 9.2	
第十二周	5月10日	20 多元回归模型的一般化: 模型设定(2) 9.3 - 9.4	
	5月11日	21 多元回归模型的一般化: 自相关(1) 12.1-12.2	
第十三周	5月17日	22 多元回归模型的一般化: 自相关(2) 12.3-12.4	
	5月18日	23 工具变量(1) 15.1 - 15.2	作业(4)
第十四周	5月24日	24 工具变量(2) 15.3	
	5月25日	期末复习	作业(4) 上交
第十五周	5月31日	期末考试	