

## 中级计量经济学 3 班——2018 年春季学期双学位课程介绍

### 北京大学国家发展研究院

上课时间： 周二 7-8 节 周四 7-8 节（双周） 地点： 二教 203  
习题课： 周四 7-8 节（单周） 习题课地点： 二教 203  
任课教师： 黄 卓 办公室： 国家发展研究院 623  
电话： 010-62751424 email: [zhuohuang@nsd.pku.edu.cn](mailto:zhuohuang@nsd.pku.edu.cn)

助教： 待定

#### 先修课

微积分、线性代数、概率统计、经济学原理

#### 教材

必备： 世纪高教·经济学英文版教材：计量经济学（第三版）（英文版）  
[Introduction to Econometrics Third Editon] 格致出版社  
京东购买链接：  
<http://item.jd.com/11583008.html>

#### 课程简介

本课程介绍计量经济学的基本理论和方法，旨在培养在实证研究使用相应理论与方法的能力。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计量软件对实际经济问题展开实证分析。

#### 考试时间

期末考试时间：2018.06.26 下午

期中考试时间：待定。

#### 要求

1. 课程考核由作业（20%）、期中考试（30%）和期末考试（50%）组成。
2. 作业共四次，每次占总分 5%。作业需在截止日期上课前交给助教。
3. 鼓励同学作业时互相讨论，但须独立写作完成，不得抄袭。只要一次作业抄袭证据确凿，所有笔头作业成绩计零分，并按校规处理。同等对待抄袭者和提供作业者。
4. 期中、期末考试方式为闭卷。缺考则当次考试成绩计零分，无补考。

## 课程内容

### 第一部分 导论与复习

- 第 1 章 经济问题与数据
- 第 2 章 概率论复习
- 第 3 章 统计学复习

### 第二部分 回归分析基础

- 第 4 章 单回归量线性回归（一元线性回归）
- 第 5 章 单回归量的线性回归：假设检验与置信区间
- 第 6 章 多回归量线性回归
- 第 7 章 多元回归的假设检验与置信区间
- 第 8 章 非线性回归函数
- 第 9 章 基于多元回归的研究评价

### 第三部分 回归分析的深入讨论

- 第 10 章 面板数据的回归
- 第 11 章 两元因变量的回归
- 第 12 章 工具变量回归

### 第四部分 经济时间序列的回归分析

- 第 14 章 时间序列回归与预测的导论
- 第 15 章 动态因果效应的估计
- 第 16 章 时间序列回归的补充内容