#### 计量经济学II教学计划

#### (Econometrics II)

国家发展研究院

二零一七年春季

任课教师： 沈 艳 上 课 时 间： 周二下午 7-9 节

上课地点： 三教207 预约答疑时间： 周三上午 10:00-11:30

办公室 ： 经济中心605室 电 话： 62767418

email ： yshen@nsd.pku.edu.cn

助教 ：

Email ：

**内容介绍:**

作为计量经济学I的继续, 本课程侧重介绍微观计量方法(Microeconometrics)及其在实证中的应用，主要涉及离散数据(Discrete Data)、受限因变量(Limited Dependent variables)、面板数据等相关的方法和运用。课程介绍因变量为离散数据(discrete data) 和删失、截断数据(truncated and censored data)的截面数据模型的估计和推断，然后介绍线性面板数据静态模型和动态模型，并对处理效应(treatment effect), 空间相关模型等作初步介绍。

本课程要求学生有足够的时间课后消化课上的内容并阅读列出文献以加强对所学内容的理解。 在课程结束时, 学生应掌握面板数据的基本模型和分析方法, 并能在自己的实证研究中熟练运用这些方法解决问题。

**教材:**

*Analysis of Panel Data,* by Cheng Hsiao (Third Edition), Cambridge University Press, 2014。

高级计量经济学及STATA应用，第二版，2014，高等教育出版社。

**参考书目:**

Kenneth Train, *Discrete Choice Methods with Simulation.* Cambridge UP. 2003.

Downloadable (with additional material) from <http://elsa.berkeley.edu/books/choice2.html>

G.S. Maddala (1983), *Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics, Cambridge University Press.*

T. Amemiya (1985), *Advanced Econometrics,* Harvard University Press.

*Econometric Analysis of Cross Section of Panel Data*, Wooldridge, J.M. (2002), MIT Press.

**考核方式：**

平时作业20%, 期中测验 30％， 期末测验 30%； 期末论文 20％ 。

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **周次** | **日期** | **内容** |
| 1 | 2月21日 | 回顾与课程介绍 |
|  |  | 工具变量，2SLS和GMM |
| 2 | 2月28日 | 离散选择模型：两个选项模型 |
|  |  |  |
| 3 | 3月 7 日 | 离散选择模型：多个选项模型 |
|  |  |  |
| 4 | 3月 14日 | 排序与计数模型 |
|  |  |  |
| 5 | 3月 21日 | 受限被解释变量模型 |
|  |  |  |
| 6 | 3月 28日 | 面板数据模型 I |
|  |  |  |
| 7 | 4月 4日 | 面板数据模型 II |
|  |  |  |
| 8 | 4月11日 | **MIDTERM** |
|  |  |  |
| 9 | 4月 18日 | 贝叶斯估计 |
|  |  |  |
| 10 | 4月25日 | 动态面板数据模型 |
|  |  |  |
| 11. | 5月 2日 | 非线性面板数据模型 |
|  |  |  |
| 12 | 5月 9日 | 空间相关模型 |
|  |  |  |
| 13 | 5月16日 | 处理效应模型I |
|  |  |  |
| 14 | 5月23日 | 处理效应模型II |
|  |  |  |
| 15 | 5月 30日 | 久期分析模型 |
|  |  |  |
| 16 | 6月6日 | 分位数回归 |
| 17 | 6月13日 | **FINAL** |
|  |  |  |
|  | 7月15日 | **TERM PAPER DUE** |