

金融计量经济学

课程编号：02812070

授课对象：硕士研究生

学 分：3

任课教师：王亚平

课程类型：专业必修

开课学期：2014 秋

先修课程：计量经济学 I

任课教师联系方式：ywang@gsm.pku.edu.cn, 62754805

辅导、答疑时间：周四下午 2—5 点

一、项目培养目标

学习目标 1 系统掌握从事学术研究所需要的专业知识及理论。

具体目标 1、系统掌握本学科基础知识及基本理论

具体目标 2、掌握本学科前沿知识和理论、具有足够的相关领域的知识

具体目标 3、熟练掌握本学科的研究方法

学习目标 2 具有从事创新性研究的能力；能够撰写并发表高质量的毕业论文和学术论文

具体目标 1、撰写高质量的毕业论文和学术论文

具体目标 2、具有高水平的分析能力和批判思维能力，能够创造性地解决问题

学习目标 3 具有宽阔的国际视野，能够与国际学者进行交流、合作的能力。

具体目标 1、具有优秀的口头交流和文字交流能力

具体目标 2、能够熟练地运用至少一门外语进行学术交流与沟通

学习目标 4 了解学术伦理，具有强烈的社会责任感、关注社会问题

具体目标 1、了解社会责任感的重要性

具体目标 2、了解学术生涯中的学术道德问题

具体目标 3、关注现实社会问题

二、课程概述

本课程将先回顾初级计量经济学的主要内容，再讲授中级计量经济学理论和如何利用计量经济学方法解决金融经济学中的具体问题。计量经济学理论主要包括线性模型的内生问题，离散选择模型及时间系列分析等。计量经济学的应用将基于论文讲解在应用的基本步骤、常见问题及计算机软件。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培养目标

学生将学会中级计量经济学的基本方法和工具，具备利用计量经济学方法分析具体的金

融经济学问题的能力，包括 SAS 等计量经济学软件。学期结束时，学生将能应用金融计量经济学的方法独立完成一项实证研究。

四、内容提要及学时分配

周次	日期	内容
		第一部分：横截面模型
1		Review of OLS (导论, OLS 概念)
2		Review of OLS (模型设定, 论文问题)
3		Review of OLS (数据问题, 时间系列数据)
4		Panel data
5		Panel data
6		工具变量法
7		工具变量法
8		受限选择
		第二部分：时间系列模型
9		ARMA (E.2, T.2)
10		ARMA (E.2, T.2)
11		Stochastic volatility (E.3, T.3)
12		Stochastic volatility (E.3, T.3)
13		Vector autoregression models (E.5, T.8)
14		Vector autoregression models (E.5, T.8)
15		Cointegration

注：可能会因学校放假而做调整

五、教学方式

课堂讲解 + 上机

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

Powerpoint

七、教材

《Introductory Econometrics: A Modern Approach》, J. M. Wooldridge

《应用计量经济学：时间序列分析》，W. Enders, 杜江, 谢志超 译高等教育出版社

八、参考书目

《Analysis of Financial Time Series》, R. S. Tsay

《Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data》, J. M. Wooldridge

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

十、课程学习要求及课堂纪律规范

参加讨论、完成作业。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

平时成绩 10% + 课堂随机小测验 30% + 期末考试 60%