

高级计量经济学

课程编号： 02810100

授课对象：研究生

学 分： 3

任课教师：虞吉海

课程类型：必修

开课学期：2013 秋

先修课程：

任课教师联系方式：jihai.yu@gsm.pku.edu.cn

辅导、答疑时间：下午

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

本课程是高级计量经济学系列课程的第一门课（总共两门），主要对一些基本的估计方法和计量模型进行研究。我们先对线性单方程的 OLS 估计进行回顾，然后对单方程的其他估计方法以及多方程和一些非线性模型进行研究。

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

经过三个月的学习，学生对计量经济学的经典线性回归模型有扎实的了解（OLS 估计及检测），并且对一些其他估计方法和计量模型有一定程度的了解。结束课程之后，学生可以运用计量或统计软件对实际数据进行简单的估计和检测。

四、内容提要及学时分配

一学期总共有 14 周左右的上课时间。

阶段 1: 线性回归模型的 OLS, GLS 估计和检测

阶段 2: MLE 方法以及其在非线性模型中的应用

阶段 3: 联立方程组模型以及 IV, GMM 方法

阶段 4: 面板数据

时间允许的话, 会讲空间计量模型。

以上每个阶段耗时 3-5 周左右。

五、教学方式

以老师讲解为主, 学生可以自由提问。

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

以黑板为主。

七、教材

Introductory Econometrics: A Modern Approach Author: Jeffrey M. Wooldridge

Econometric Analysis Author: William H. Greene

八、参考书目

Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data

Author: Jeffrey M. Wooldridge

An Introduction to Classical Econometric Theory

Author: Paul Arthur Ruud

九、教学辅助材料, 如 CD、录影等

无

十、课程学习要求及课堂纪律规范

上课之前做好一定的预习, 课堂认真听讲。要求对教学内容理解, 不是死记硬背。

课堂纪律以不能影响他人学习为准。

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)

三次作业, 每次 10 分。一次期末考试, 70 分。

考试总分是三次作业加上期末考试, 满分 100 分。