

## 课程大纲

### 金融计量经济学

课程编号：02812070

学 分：3

课程类型：必修

先修课程：计量经济学 I

授课对象：金融硕士

任课教师：王亚平

开课学期：2015 年秋

任课教师简历（500 字左右）：

王亚平现任北京大学光华管理学院金融系副教授，在此之前，他曾在江西省九江市计划委员会，国家发改委和 ABN AMRO Bank(Chicago)工作。王亚平教授毕业于中国科技大学管理科学专业，后在人民大学获得经济学硕士学位。1998 年他在杜克大学获得经济学博士学位。

目前他的研究领域主要在于资产定价、最优投资策略和计量经济学应用，他教授的课程有高级金融理论、高级金融理论专题和高级微观经济学



任课教师联系方式：

[ywang@gsm.pku.edu.cn](mailto:ywang@gsm.pku.edu.cn), 62754805

助教姓名及联系方式：

辅导、答疑时间：

#### 一、项目培养目标

**Program objective 1** Introducing frontier theories of finance, economics, and management; helping students establish the ability to apply theoretical knowledge and solve real world financial problems.

Specific objectives include

- Obtaining systematic understanding of finance, economics, and management theories;
- Mastering quantitative analysis skills;
- Applying theoretical knowledge in class to real problems.

**Program objective 2** Building strong communication skills to help students work in financial institutions and companies. Specific objectives include

- Fostering strong oral communication skills;
- Fostering effective written communication skills;
- Building team work spirits.

**Program objective 3** Establishing social responsibility and business ethics.

**Program objective 4** Gaining an international perspective. Specific objectives include

- Understanding the cultural variety in the financial industry;
- Knowing different financial systems around the world;
- Preparing for effective work at multinational financial institutions.

## 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

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
2		Review of OLS
3		工具变量法
4		工具变量法
5		时间系列数据问题
6		面板数据模型
7		面板数据模型
第二部分：时间系列模型		
8		ARMA ( E.2 , T.2 )
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 autoregressive models ( E.5 , T.8 )
14		Vector autoregressive models ( E.5 , T.8 )
15		Cointegration

注：可能会因学校放假而做调整

期末考试时间：

## 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 20% + 期末考试 80%

## 十二、 项目培养目标的考核方式与标准（仅适用于参与保障教学效果评估(Assurance of Learning)的

课程：高级微观经济学、宏观经济管理、财务分析应用、金融计量经济学、金融 I、金融 II、金融 III)