**山东建筑大学**

**2023研究生入学考试《计量经济学》考试大纲**

**一、考试内容**

（一）线性回归模型

1. 了解总体回归方程和样本回归方程；

2. 掌握古典回归模型的假定；

3. 掌握OLS估计法的基本原理和估计量的推导；

4. 掌握参数的估计误差与置信区间的计算；

5. 掌握回归模型统计显著性检验的意义和方法；

6. 掌握回归模型的拟合优度的计算；

7. 掌握回归模型参数意义的解释。

（二）非线性回归模型的线性化

1. 掌握刻画变量间的非线性关系的方法；

2. 掌握非线性转化为线性模型的方法。

（三）大样本OLS

1. 了解大样本理论的思想—大数定理与中心极限定理；

2. 理解大样本OLS的假定；

3. 掌握大样本OLS的性质。

（四）异方差

1. 了解异方差的定义、产生原因和影响；

2. 掌握异方差的检验和修正方法。

（五）自相关

1. 了解自相关的定义、产生原因和影响；

2. 掌握自相关的检验和修正方法。

（六）多重共线性

1. 了解多重共线性的定义、产生原因和影响；

2. 掌握多重共线性的检验和修正方法。

（七）模型设定与数据问题

1. 理解回归模型中随机解释变量的后果，掌握获得工具变量的方法和工具变量有效性的检验，并利用工具变量法估计模型参数；

2. 掌握设定虚拟变量和模型估计的方法以及理解模型回归参数的意义；

3. 了解选择变量的滞后阶数的方法和确定模型的解释变量个数的方法；

4. 掌握模型函数形式的检验；

5. 掌握模型的结构变动检验，并进行参数估计。

（八）二值选择模型

1. 掌握建立二值选择模型 (Probit模型、Logit模型)的基本理论；

2. 掌握最大似然估计法；

3. 掌握二值选择模型边际效应的计算以及理解回归参数的经济意义。

（九）面板数据

1. 了解面板数据模型的特点；

2. 掌握建立面板数据模型的策略（混合法、固定效应模型、随机效应模型），以及模型的估计方法；

3. 掌握面板数据模型拟合优度的度量。

（十）平稳时间序列

1. 了解时间序列模型的特点；

2. 掌握建立自回归模型和自回归分布滞后模型的基本原理；

3. 掌握误差修正模型的长期效应与短期效应的计算；

4. 理解脉冲响应函数意义；

5. 掌握自回归模型和向量自回归模型的估计方法以及理解模型参数的意义；

6. 掌握格兰杰因果检验。

（十一）单位根与协整

1. 了解非平稳时间序列模型的特点；

2. 掌握单位根检验；

3. 掌握协整的思想和初步检验；

4. 掌握协整的最大似然估计法以及理解模型参数的意义。

**二、参考教材**

1. 陈强.《计量经济学及Stata应用》，高等教育出版社，2015；

2. 张晓峒.《计量经济学基础》(第4版)，南开大学出版社，2014；

3. 李子奈，潘文卿.《计量经济学》(第4版)，高等教育出版社，2015。