

**硕士研究生招生考试**

**《计量经济学》科目大纲**

(科目代码：519)

学院名称(盖章)： 经济学院

学院负责人(签字)：

编 制 时 间： 2023 年 6 月 27 日

《计量经济学》科目大纲

（科目代码：519）

一、考核要求

要求考生掌握计量经济学的基本原理和方法，包括计量经济学的基本概念、步骤、方法、应用等。主要内容有单方程线性计量经济模型的基本概念、基本假定、参数估计方法、模型检验方法，违背经典计量经济学基本假设问题的检验方法和解决方法。掌握时间序列计量经济学模型相关概念、基本理论和建模步骤。掌握非经典截面数据计量经济学模型基础。考生应具备较好的计算能力、分析能力、基本的推导证明能力和实际应用问题的处理能力。

二、考核评价目标

1、单方程线性计量经济模型的基本概念、基本假定、参数估计方法、模型检验方法。

2、违背计量经济模型的基本假定相关问题（异方差、序列相关、多重共线性、随机解释变量）的判断、检验与处理。

3、特殊变量（虚拟变量、滞后变量）的使用及参数估计。

4、时间序列计量经济学模型的概念、平稳性检验、协整检验和格兰杰因果关系检验的原理。

5、非经典截面数据计量经济学模型基本概念、基本方法。

三、考核内容

第一章 绪论

第一节 计量经济学

第二节 建立经典单方程计量经济学

第三节 计量经济学模型的应用

第四节 本书内容安排说明

第二章 经典单方程计量经济学模型：一元线性回归模型

第一节 回归分析概述

第二节 一元线性回归模型的基本假设

第三节 一元线性回归模型的参数估计

第四节 一元线性回归模型的统计检验

第五节 一元线性回归分析的应用：预测问题

第六节 建模实例

第三章 经典单方程计量经济学模型：多元线性回归模型

第一节 多元线性回归模型

第二节 多元线性回归模型的参数估计

第三节 多元线性回归模型的统计检验

第四节 多元线性回归模型的预测

第五节 可化为线性的多元非线性回归模型

第六节 含有虚拟变量的多元线性

第七节 受约束回归

第四章 经典单方程计量经济学模型：放宽基本假定的模型

第一节 多重共线性

第二节 异方差性

第三节 内生解释变量问题

第四节 模型设定偏误问题

第五章 时间序列计量经济学模型

第一节 时间序列模型的序列相关性

第二节 时间序列的平稳性及其检验

第三节 协整与误差修正模型

第四节 格兰杰因果关系检验

四、参考书目

1、《计量经济学》，李子奈、潘文卿主编，高等教育出版社，2016年10月第四版

2、《计量经济学导论：现代观点》，杰弗里•M.伍德里奇主编，中国人民大学出版社，2015年5月第五版