

上海财经大学 2023—2024 学年第 2 学期教学进度表

开课院系: 经济学院 课程名称 高级计量经济学 II

总课时 48 (其中讲课 48 课时, 实验 0 课时)

讲课教师 李聪 ☐ 多媒体 ☐ 实验 ☐ 全英 (若“是”则在方框中打☑)

周次	月/日	讲课内容	讨论/实验	阅读	作业
1	2/28	简单回顾线性模型, 假设检验并提供更多理论依据, 以及经典假设不成立时的处理			
2	3/6	工具变量法, 矩估计, 广义矩估计; 以及相关假设检验			
3	3/13	M-估计的构成, 渐进分布, 两部 M-估计			
4	3/20	非线性最小二乘, 常见数值迭代法			作业 1
5	3/27	分为数回归			
6	4/3	简单平稳时间序列模型, 检验残差相关性			
7	4/10	非平稳时间序列模型, 及渐进结果			
8	4/16	期中考试			
9	4/24	三种常用面板模型的定义, 估计和比较, 广义矩估计			
10	5/1	工具变量估计固定和随机效用模型, 测量误差, 序列外生			
11	5/8	个体斜率不同的面板数据模型			作业 2
12	5/15	二元选择模型, 多项选择模型			
13	5/22	被删减数据的模型和受限数据的模型			
14	5/29	简单介绍非参数模型			
15	6/5	非参数连续数据模型			作业 3
16	6/12	非参数混合数据模型			
	阅 读 材 料 目 录	课堂笔记。参考书包括: Econometrics Analysis, 5 th E, William Greene. Econometric Theory and Methods, (2004), Russell Davidson and James MacKinnon. Econometric analysis of cross section and panel data, 2 nd E, Jeffrey Wooldridge. 高级计量经济学及 stata 应用, (第二版), 陈强			