

# 上海财经大学 2023 - 2024 学年第 一 学期教学进度表

经济学院 系 专业 博士生 年级 班 课程名称 高级计量经济学 I

总课时 48 本学期安排课时数 48 (其中讲课 45 课时, 期中考试 3 课时)

讲课教师 周建 辅导教师 张志朋

(若放假调整, 则根据相应时间安排进行顺调)

周次	月/ 日	讲 课		期中考试	
		时数	内 容	时数	内容
1	9 月/5 日	3	<b>第一章 绪论</b> 计量经济学形成发展、体系结构、分类、计量软件; 基础经济学、数学、统计简要总结; 计量经济学模型研究思想、分析程序; 计量模型要素、检验及诊断;		
2	9 月/12 日	3	<b>第二章 经典线性回归模型</b> 计量经济学线性模型特征、价值、普遍性; 线性模型 OLS 估计古典假设; OLS 参数估计量矩阵表示及性质;		
3	9 月/19 日	3	OLS 目标函数设定、变系数模型; 分位数回归模型; ML 方法原理、似然函数、MM 矩估计及等价; 正规方程组推导; 诊断检验;		
4	9 月/26 日	3	参数估计量置信区间及预测; 统计推断特征 (布置作业)		
5	10 月/3 日	3	<b>第三章 经典线性回归模型扩展</b> 违背古典假设及其扩展: 异方差产生原因、后果及检验与克服 (异方差检验; WLS 估计及计算, White 的协方差估计 (HCCME), Newey-West 的协方差矩阵 (HAC) 估计);		
6	10 月/10 日	3	序列相关产生原因、后果及检验与克服 (序列相关检验 (DW 检验, Box-Pierce 检验, Ljung-Box 检验等; GLS 估计; 差分法);		
7	10 月/17 日	3	多重共线性的背景及后果与诊断; 分部回归; 模型形式设定扩展: (布置作业)		

周次	月/ 日	讲 课		期中考试	
		时数	内 容	时数	内容
8	10月/24日	3	内生性问题（遗漏变量，度量误差，联立方程组等）及后果，工具变量（IV）估计和GMM估计，内生性检验（Durbin-Wu-Hausman检验）；		
9	10月/31日			3	期 中 考试
10	11月/7日	3	从“线性回归”到“非线性回归”；约束条件的三大检验：Wald检验，LR检验，LM检验；模型选择及设定检验：模型形式设定选择；结构变化检验（Chow检验，CUSUM检验等）。 <b>第四章 离散选择和受限制数据模型</b> 二元离散选择模型及其经济背景（若放假则顺延）		
11	11月/14日	3	二元Logit和Probit模型及其参数估计；二元离散选择模型的检验；多元离散选择模型及其经济背景；嵌套多元选择模型及排序多元离散选择模型；受限制数据模型：截断数据模型和归并数据模型 (布置作业)		
12	11月/21日	3	<b>第五章 时间序列计量经济学</b> 时间序列平稳性、单整、单位根；单位根过程，单位根检验（DF和ADF检验）；时间序列模型的识别、特征与检验（Box-Jenkins方法，AIC和BIC准则）；		
13	11月/28日	3	长期均衡协整分析；协整检验（Engle-Granger方法，Johansen方法）；误差修正模型（ECM）； (布置作业)		
14	12月/5日	3	VAR模型及误差修正模型VECM，结构VAR建模和脉冲反应； 条件异方差模型及其扩展（ARCH、GARCH等估计及其应用）；		
15	12月/12日	3	<b>第六章 面板数据计量经济学前沿及扩展</b> 面板数据优势、特征；面板数据理论体系；混合回归与面板数据模型建立；变截距模型：固定影响/随机影响；LSDV模型及参数估计；FGLS估计；固定影响/随机影响的检验——Hausman检验理论思想及现实表现；变系数模型：固定影响/随机影响；动态面板模		

周次	月/ 日	讲 课		期中考试	
		时数	内 容	时数	内容
			型:固定影响、随机影响; GMM、IV; 面板模型其它: 联立模型; 离散数据模型; 选择性样本; 不完全面板; 单位根协整		
16	12月/19日	3	复习		
指定教材和教学参考书			William H. Greene, Econometric Analysis, 5th edition (有中译本) 《高级应用计量经济学》, 李子奈、叶阿忠, 清华大学出版社, 2012年2月		

注: 本表一式四份, 一份送教研室, 一份送讲课班级, 一份送教务处, 一份讲课教师自留。 教研室主任。