

高级计量经济学 II

(2024 年春季)

授课教师

李聪

答疑时间：周三 15:30-17:30

办公室：经济学院 309

E-mail: li.cong@mail.shufe.edu.cn

助教

魏思杰

E-mail: weisijie@163.sufe.edu.cn

答疑时间：待定

课程类别

学位基础课

课程安排说明

2024 年 2 月 28 日—2024 年 6 月 12 日

授课时间：周三 18:00-20:35

授课地点：四教 213

期中考试时间：4 月 16 日下午 13:00-15:00

课程语言

请在相应的表格里打“√”

	教材	讲义	讲授语言	期中考试	期末考试
中文			√		
英文	√	√		√	√
其他 (请注明)					

教材

指定教材：本课程课堂笔记。

参考书目：Econometrics Analysis, 5th E, William Greene.

Econometric Theory and Methods, (2004), Russell Davidson
and James MacKinnon.

Econometric analysis of cross section and panel data, 2nd E,
Jeffrey Wooldridge.

高级计量经济学及 stata 应用, (第二版), 陈强

Nonparametric econometrics (2007), Qi Li and Jeffrey

Racine

预备知识

本课程为计量经济学的高级课程，我将假设同学们已经了解计量经济学的基础知识，并在此前提下讲授课程。具体预备知识包括基础的概率统计知识；经典线性模型的假设，理论推导和模型的性质；假设检验的构造；基本的模型估计方法；以及在经典线性模型的假设不成立时如何来估计，等。

教学目的

本课程将讨论诸多计量经济学的经典模型和更为新近的模型。课程将为你提供更为坚实的计量经济学思想，为计量经济的应用提供坚实的理论基础。我们从简单回顾以前所学经典模型开始，讨论更多被大家广泛应用的适用于不同情况的计量经济学模型。模型的成立是建立在不同假设条件下的，本课程将讨论如何在假设发生变化的情况下，模型还能有效工作。

分数说明

我们将有 3 次作业，1 次期中考试，和 1 次期末考试。各部分所占总分的比例如下：

作业（3 次）	30%
期中考试	30%
期末考试	40%

要求

除非你能证明有特殊情况，例如疾病，否则不能以任何借口缺课或不参加考。如果无故不参加考试，给予 0 分。你可以和同学讨论课后作业，但是不可以抄袭别人的作业。如发现雷同作业，则所有雷同作业都记 0 分。不可以无故晚交或迟交作业，如果有这种情况发生，当次作业记 0 分。

学术诚实

涉及学生的学术不诚实问题主要包括考试作弊；抄袭；伪造或不当使用在校学习成绩；未经老师允许获取、利用考试材料；对于学术不诚实的最低惩罚是考试给予 0 分。其他的惩罚包括通告学校相关部门并按照有关规定进行处理。

教学内容安排

回顾

2月28日	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
3月6日	工具变量法，矩估计，广义矩估计；以及相关假设检验
M-估计，非线性最小二乘, 分为数回归	
3月13日	M-估计的构成，渐进分布，两部 M-估计
3月20日	非线性最小二乘, 常见数值迭代法
3月27日	分为数回归
时间序列	
4月3日	简单平稳时间序列模型，检验残差相关性
4月10日	非平稳时间序列模型, 及渐进结果
4月16日	期中考试
面板数据	
4月24日	三种常用面板模型的定义，估计和比较，广义矩估计
5月1日	工具变量估计固定和随机效用模型，测量误差，序列外生
5月8日	个体斜率不同的面板数据模型
离散选择：删减, 受限数据模型	
5月15日	二元选择模型，多项选择模型
5月22日	被删减数据的模型和受限数据的模型
非参数计量经济模型	
5月29日	简单介绍非参数模型
6月5日	非参数连续数据模型
6月12日	非参数混合数据模型