附件1：课程教学方案基本格式

**《高级计量经济学》课程教学方案**

（2017——2018学年第一学期）

**课程名称（中文）**：高级计量经济学

**课程名称（英文）**：Advanced Econometrics

**课程性质**：□公共课 √学位基础课 □选修课

**预修课程**：高等数学、线性代数、数理统计

**修读对象**：经济学研究生一年级

**任课教师**：司继春

**办公地点**：乐群楼205

**答疑时间：**1-17周：周二3-4节、周三3-12节、周四5-6节、1-16周单周：周二5-6节；1-17周单周：周四7-8节

**联系电话**：021-67703578

**E-mail地址**：si.jichun@outlook.com

**教 材**：《计量经济学导论：现代方法（第六版）》，伍德里奇

**参考书目**：

《Econometrics analysis of cross sectional and panel data》, Wooldridge

《Mostly harmless econometrics》,Angrist and Pischke

《Econometric Analysis》，Greene

《Microeconometrics: methods and applications》，Cameron and Trivedi

《Microeconometrics using Stata》，Cameron and Trivedi

**主要内容**：

本课程主要介绍计量经济学，特别是微观计量经济学的方法和应用。本课程主要包括三部分，第一部分包含了学习计量经济学的基本知识，如线性代数、投影、幂等矩阵、条件期望、大样本理论等基本的理论知识；第二部分包含了计量经济学的基础内容，包括古典线性回归方法、现代最小二乘方法以及内生性和工具变量方法；第三部分包括一部分微观计量经济学的应用，如处理效应的识别与估计、自然实验的思想以及一部分面板数据的初步。此外，本课程还将包含一部分使用Stata软件处理计量模型的内容。

**教学目标：**

本课程的主要目标是使学生掌握基础的计量经济学工具，并深入理解计量经济学的思想和方法，特别是对于内生性问题的理解和解决方法。要求学生能在理解的基础之上正确的选择和使用计量经济学模型，并利用统计软件对经济学的理论问题进行实证分析，为接下来其他科目的经济学学习做好计量经济学的准备。

**教学模式：**

本课程主要教学方法为课堂讲授，并为学生提供讲义、数据、程序代码等其他辅助材料。

**考核方式（开卷/闭卷/论文）：闭卷**

**考核与评分：平时成绩\_\_50\_\_%,期末成绩\_\_50\_\_%**

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **比例** |
| 出勤 | 20% |
| 作业与讨论 | 30% |
| 期末考试 | 50% |

**教学进度：**

|  |  |
| --- | --- |
| **周 次** | **教 学 内 容** |
| 1 |  |
| 2 |  |
| 3 |  |
| 4 |  |
| 5 |  |
| 6 | 导论：什么是计量经济学、Stata软件初步 |
| 7 | 线性代数复习：线性变换、投影与幂等矩阵 |
| 8 | 概率统计复习：条件期望、大数定律、中心极限定理 |
| 9 | 估计方法：极大似然估计 |
| 10 | 估计方法：矩估计与广义矩估计 |
| 11 | 古典线性回归：最小二乘法、R2、F统计量、有限样本分布 |
| 12 | 古典线性回归：分步回归、受限最小二乘、假设检验 |
| 13 | 线性回归：矩估计方法、大样本性质、异方差 |
| 14 | 内生性与工具变量：内生性问题、两阶段最小二乘法 |
| 15 | 内生性与工具变量：控制函数法、LIML、弱工具 |
| 16 | Rubin因果模型与匹配法 |
| 17 | 局部平均处理效应（LATE）与断点回归 |
| 18 | 基本的面板数据：随机效应与固定效应、双重差分模型 |

**学生须知：**

⒈研究生课程无论采取哪一种考核形式均采用百分制评定成绩。学位课70分以下为不及格，非学位课60分以下为不及格。

⒉研究生一门课程旷课时数达到该门课程总课时数的三分之一，将取消该研究生该门课程的考试资格，该门课程成绩作零分处理。

3.未办理选课手续的不得参加课程考核。

4.学生需完成全部纸质作业及编程作业。所有作业（包括纸质作业和编程作业）不得抄袭，一旦发现作业抄袭，平时成绩（出勤、作业）判为0分。

2017年9月