附件1：课程教学方案基本格式

**《数量经济学前沿》课程教学方案**

（2017——2018学年第二学期）

**课程名称（中文）**：数量经济学前沿

**课程名称（英文）**：Frontiers of Quantitative Economics

**课程性质**：□公共课 □学位基础课 √选修课

**预修课程**：计量经济学、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**：《Econometric Analysis》，Greene

**参考书目**：

1. 《The elements of Financial Econometrics》,Jianqing Fan and Qiwei Yao
2. 《金融计量学》，姜近勇、潘冠中
3. 《Causal Inference for Statistics, Social, and Biomedical Sciences》, Imbens and Rubin
4. 《Matching, Regression Discontinuity, Difference in Differences, and Beyond》, Myoung-jae Lee
5. 《Micro-econometrics for Policy, Program, and Treatment effects》， Myoung-jae Lee
6. 《Discrete Choice Methods with Simulation》, Kenneth E. Train
7. 《Econometrics analysis of cross sectional and panel data》, Wooldridge
8. 《Mostly harmless econometrics》,Angrist and Pischke
9. 《Microeconometrics: methods and applications》，Cameron and Trivedi
10. 《Microeconometrics using Stata》，Cameron and Trivedi

**主要内容**：

本课程主要介绍数量经济学，特别是计量经济学的前沿方法和理论。该课程包括三部分：第一部分主要介绍时间序列、金融计量的基础知识以及前沿理论，包括证券收益率的典型事实、资本资产定价模型及其检验、因子定价模型、波动率模型、事件分析法以及部分连续时间金融的主要内容；第二部分主要包括处理效应的基础知识和前沿理论，主要包括Rubin因果模型、无混淆假设与匹配方法、局部平均处理效应、双重差分模型、断点回归模型、边际处理效应模型等；第三部分包括主要包括简单的离散选择模型，包括简单的二元选择模型、多远选择模型以及部分随机系数离散选择模型等。

**教学目标：**

本课程的主要目标是使学生在具有初步的计量经济学工具学习的基础之上，更加深入理解计量经济学的思想和方法，根据学生的兴趣，对于金融计量、微观计量、结构计量至少一个方面有比较清晰的认识，并学会使用这些工具处理研究中的计量问题，最终使用统计软件进行经济科学的数据分析。

**教学模式：**

本课程主要教学方法为课堂讲授以及学生汇报论文相结合，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）：论文**

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

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **比例** |
| 出勤 | 20% |
| 作业与汇报 | 40% |
| 期末考核 | 40% |

**教学进度：**

|  |  |
| --- | --- |
| **周 次** | **教 学 内 容** |
| 1 | 课程介绍、资产收益率及其典型事实 |
| 2 | 平稳时间序列 |
| 3 | 平稳时间序列：ARCH/GARCH |
| 4 | 非平稳时间序列：随机游走检验 |
| 5 | 资本资产定价模型及其检验 |
| 6 | 因子定价模型及其检验 |
| 7 | 事件分析法 |
| 8 | 布朗运动、泊松过程、伊藤积分与伊藤引理 |
| 9 | 连续时间金融模型的估计方法 |
| 10 | 论文汇报 |
| 11 | Rubin反事实因果框架 |
| 12 | 无混淆假设与匹配方法 |
| 13 | 局部平均处理效应 |
| 14 | 断点回归模型 |
| 15 | 边际处理效应 |
| 16 | 离散选择模型 |
| 17 | 论文汇报 |
| 18 |  |

**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