

# 中国社会科学院大学《中级计量经济学》课程大纲

课程基本信息 (Course Information)					
课程编号 (Course ID)		*学时 (Credit Hours)	32	*学分 (Credits)	2
*课程名称 (Course Name)	中级计量经济学				
	Intermediate Econometrics				
先修课程 (Prerequisite Courses)	《概率论与数理统计》《线性代数》《计量经济学》				
*课程简介 (Description)	<p>本课程定位于高年级本科生。课程的目标：通过本门课程的学习，使学生掌握计量经济学的基本理论和方法，能够使用 Stata 对经济问题进行分析，提高计量经济学的理论基础与实际应用能力。同时为研究生阶段的高级计量经济学学习打下扎实的基础。本课程的主要教学内容主要包括 Stata 应用、一元线性回归模型、多元回归模型的估计、多元回归模型的推断、多元回归模型的大样本性质、多元回归模型：深入专题、虚拟变量、异方差性、自相关性、面板数据模型、工具变量估计。重点在于全面系统的理解计量经济学框架，难点在于将计量经济学方法运用于具体的经济问题研究中。</p> <p>要在课程教学中坚持以马克思主义为指导，加快构建中国特色哲学社会科学学科体系、学术体系、话语体系。引导学生深入社会实践、关注现实问题，培育学生经世济民、诚信服务、德法兼修的职业素养。能够基于所学计量经济学知识为国家发展做出贡献。</p> <p>关注学生学习效果，除了学习理论知识外，加大软件学习比重。理论指导实践，实践反哺理论，综合提高理论和实践能力。同时，帮助学生理解和掌握数理统计知识在计量经济学的应用，深层次理解计量经济学的理论与实践，多与学生互动交流，关注学生需求，根据学生要求和能力调整课程难度和挑战性。</p>				
*课程简介 (Description)	<p>This course is aimed for senior undergraduate students. Objective of the course: Through the study of this course, students will master the basic theories and methods of econometrics and be able to use Stata to analyze economic problems, so as to improve the theoretical basis and practical application ability of econometrics. At the same time, it lays a solid foundation for the advanced econometrics study in the graduate stage. The main teaching content of this course mainly includes Stata application, unary linear regression model, multiple regression model estimation, multiple regression model inference, large sample nature of multiple regression model, multiple regression model: in-depth topic, dummy variable, heteroscedasticity, autocorrelation, panel data model, instrumental variable estimation. The key is to understand the econometric framework comprehensively and systematically, while the difficulty is to apply econometric methods to the exact economic research problems.</p> <p>This course adheres to the guidance of Marxism in the course teaching, and speeds up the construction of the discipline system, academic system and discourse system of philosophy and social sciences with Chinese characteristics. This course aims to guide students to go deep into social practice, pay attention to practical problems, and cultivate students' professional quality of helping the people through the world, serving the people</p>				

	<p>with integrity, and practicing both morality and law. It can improve students' ability to contribute to national development based on their econometrics knowledge.</p> <p>This course focuses on the learning effect of students. In addition to learning basic theoretical knowledge, the proportion of software learning should be increased. Theory guides practice, and practice feeds theory. This course can comprehensively improve the theoretical and practical ability, and help students understand and master the application of mathematical knowledge in econometrics and have a deep understanding of the theory and practice of econometrics. In addition, this course will interact more with students, pay attention to their needs, and adjust the difficulty and challenge of the course according to their requirements and abilities.</p>										
*教材 (Textbooks)	《计量经济学导论：现代观点（第七版）》，Jeffrey M. Wooldridge（涂海洋 王文佳 夏苗 张成思 邹炬伸 译），中国人民大学出版社，2023.										
参考资料 (Other References)	<p>《计量经济学（第五版）》，李子奈，潘文卿，高等教育出版社，2020</p> <p>《计量经济学导论（第三版）》，James H. Stock &amp; Mark M. Watson（张涛 巩书欣 等译），中国人民大学出版社，2014.</p> <p>《计量经济学及 Stata 应用》，陈强，高等教育出版社，2015.</p>										
*课程类别 (Course Category)	<input type="checkbox"/> 公共基础课/全校公共必修课 <input type="checkbox"/> 通识教育课 <input type="checkbox"/> 专业基础课 <input type="checkbox"/> 专业核心课/专业必修课 <input type="checkbox"/> 专业拓展课/专业选修课 <input type="checkbox"/> 其他_____										
*授课对象 (Target Students)	全校本科生	*授课模式 (Mode of Instruction)		<input type="checkbox"/> 线上，教学平台_____ <input checked="" type="checkbox"/> 线下 <input type="checkbox"/> 混合式 <input type="checkbox"/> 其他 <input type="checkbox"/> 实践类（70%以上学时深入基层）_							
*开课院系 (School)	经济学院	*授课语言 (Language of Instruction)		<input checked="" type="checkbox"/> 中文 <input type="checkbox"/> 全外语_____ <input type="checkbox"/> 双语：中文+_____（外语讲授不低于 50%）							
*授课教师信息 (Teacher Information)	课程负责人 姓名及简介	李守皓，管理科学博士（数量金融），中国社会科学院大学经济学院讲师									
	团队成员 姓名及简介	无									
学习目标 (Learning Outcomes)	<p>通过本门课程的学习，使学生掌握计量经济学的基本理论和方法，能够使用 Stata 对经济问题进行分析，提高计量经济学的理论基础与实际应用能力。同时为研究生阶段的高级计量经济学学习打下坚实的基础。</p>										
*考核方式 (Grading)	平时成绩 30%，期末成绩 70%										
*课程教学计划（Teaching Plan）填写规范化要求见附件											
周次	周学时	其中									
		讲授	实验课	习题课	课程讨论 其他环节						
<p style="text-align: center;">教学内容摘要</p> <p>（必含章节名称、讲述的内容提要、实验的名称、教学方法、课堂讨论的题目、阅读文献参考书目及作业等）</p>											

第一周	2	2				第1章 绪论 第2章 简单回归模型 2.1 简单回归模型的定义 2.2 简单普通最小二乘法的推导 2.3 OLS 对任意样本数据的性质 教学方法：讲授
第二周	2	2				第2章 简单回归模型 2.4 度量单位和函数形式 2.5 OLS 估计量的期望值和方差 2.6 过原点回归及对常数的回归 教学方法：讲授
第三周	2	2				第3章 多元回归分析：估计 教学方法：讲授
第四周	2	2				第4章 多元回归分析：推断 教学方法：讲授
第五周	2	2				第5章 多元回归分析：OLS 的渐近性 教学方法：讲授
第六周	2	2				第6章 多元回归分析：深入专题 第9章 模型设定和数据问题的深入探讨 教学方法：讲授
第七周	2	2				第7章 含有定性信息的多元回归分析 教学方法：讲授
第八周	2	2				第8章 异方差性 教学方法：讲授
第九周	2	2				第15章 工具变量估计与两阶段最小二乘法 15.1 动机：简单回归模型中的遗漏变量 15.2 多元回归模型的 IV 估计 15.3 两阶段最小二乘法 教学方法：讲授

第十周	2	2					第 15 章 工具变量估计与两阶段最小二乘法 15.4 变量误差问题的 IV 解决方法 15.5 内生性检验和过度识别约束检验 教学方法：讲授
第十一周	2	2					第 13 章 跨时横截面的混合：简单面板数据方法 教学方法：讲授
第十二周	2	2					第 14 章 高级面板数据方法 教学方法：讲授
第十三周	2	2					双重差分估计、断点回归 教学方法：讲授
第十四周	2	3					第 17 章 受限因变量模型和样本选择的修正 17.1 二值响应的 logit 和 probit 模型
第十五周	2	2					第 10 章 时间序列数据的基本回归分析 第 11 章 OLS 用于时间序列数据的其他问题 第 12 章 时间序列回归中的序列相关和异方差性
第十六周	2	2					第 18 章 时间序列高级专题
总计	32	32					
备注 (Notes)							