

《计量经济学》课程教学大纲（2020 版）

课程基本信息 (Course Information)					
课程代码 (Course Code)	EC310	*学时 (Credit Hours)	48	*学分 (Credits)	3
*课程名称 (Course Name)	(中文) 计量经济学				
	(英文) Econometrics				
课程类型 (Course Type)	专业必修课				
授课对象 (Target Audience)	金融、经济、会计及相关专业本科生				
授课语言 (Language of Instruction)	全中文				
*开课院系 (School)	安泰经济与管理学院				
先修课程 (Prerequisite)	概率论与数理统计、统计学、经济学、金融学原理	后续课程 (post)	金融计量		
*课程负责人 (Instructor)	冯芸	课程网址 (Course Web page)			
*课程简介 (中文) (Description)	(中文 300-500 字，含课程性质、主要教学内容、课程教学目标等) 计量经济学是以经济理论为指导，以数据事实为依据，以数学、统计学为方法，以计量分析软件为工具，研究经济关系和经济活动数量规律及其应用，并以建立计量经济模型为核心的一门经济学学科，其根本任务是估计经济模型和检验经济模型。 《计量经济学》课程的主要内容：（1）了解计量经济学作为一门独立学科的主要思想和原理。（2）掌握基本的经典计量经济学理论与方法。（3）学会使用一种计量经济分析软件。（4）学会运用理论和分析软件，建立简单				

	的计量经济模型，对现实经济金融现象中的数量关系进行实证分析，给出具有经济含义的解释。 教学目标：通过教学，培养学生综合运用不同知识和技能，在对现实数据进行观测、分析的基础上，解释经济、金融现象和解决实际问题的能力，同时锻造从数据信息中归纳和推断事物之间逻辑关联的科学素养和研究能力。							
*课程简介（英文） (Description)	(英文 300-500 字) Econometric is a basic methodology used to analyze quantitative relations between economic variables based on observations of economic variables in reality. Guided by economic theories, econometricians focus on econometric modelling, estimation and testing, by exploiting mathematics, statistics and econometric software. The teaching contents of this course include: (1) the ideas and principles of econometric analysis; (2) basic econometric theories and methods; (3) usage of a popular econometric software; (4) empirical analysis based on econometric methods. The object of this course is to develop the ability of explaining economic events and solving problems, by employing comprehensively economic and finance theories, econometric methods and tools, as well as the ability and scientific literacy in causal inference based on observations in reality.							
课程目标与内容 (Course objectives and contents)								
*课程目标 (Course Object)	结合本校办学定位、学生情况、专业人才培养要求，具体描述学习本课程后应该达到的知识、能力、素质、价值水平。 1. 了解计量经济学作为一门独立学科的主要思想和原理。 2. 掌握基本的经典计量经济学理论与方法。 3. 学会使用一种计量经济分析软件。 4. 应用计量分析方法展开实证研究。 5. 初步形成从数据信息中归纳逻辑关系的科学素养和分析能力。							
毕业要求指标点与课程目标的对应关系 (选填，非必填项)	课程目标				毕业要求指标点			
*教学内容进度安排及对应课程目标 (Class	章节	教学内容（要点）	教学目标	学时	教学形式	作业及考核要求	课程思政融入点	对应课程目标

Schedule & Requirements & Course Objectives)	第一章	为什么需要计量经济学	理解计量分析的作用：完成经济决策和检验经济理论/假说	2	课堂讲授、互动讨论	文献阅读		课程目标 1
	第二章	计量分析的一般步骤和线性回归的基本思想	理解计量分析中的若干基本概念和区别；熟悉基本的经济金融数据库	4	课堂讲授、习题讲解	文献阅读		课程目标 1、2
	第三章	线性回归模型的统计推断：参数估计方法；OLS估计值的代数性质和统计性质；参数估计值的评价准则；基于经典假定的三种形式的假设检验及其应用。	掌握在截面数据环境经典假设条件下基本的统计推断方法	15	课堂讲授、习题讲解	课堂练习#1、期末项目		课程目标 2、3、4
	第四章	截面数据环境下经典假定的违背之一：异方差性如何产生、如何影响、如何诊断、如何校正。	运用基本的统计手段初步观测截面数据中可能存在的异方差性，从理论角度理解异方差带来的影响，并利用可行的计量分析方法对异方差进行诊断和校正	4	课堂讲授、习题讲解	课堂练习#2、期末项目		课程目标 3、4
	第五章	模型失效的两种可能（包括截面数据环境下经典假定的违背之二：遗漏变量问题）；可操作的检验方法	理解模型选择的基本原则；掌握变量非线性关系的检验方法、描述非线性关系的常用函数形式及其参数解释；掌握嵌套模型比较方法	3	课堂讲授、习题讲解	课堂练习#3、期末项目		课程目标 2、3、4

	第六章	内生性问题产生的来源；解决方法；检验方法	理解实证研究中开展因果推断常常面临的内生问题及解决思路，并运用计量分析软件解决因果推断中出现的内生性问题，提高因果推断的可靠性。	6	课堂讲授、习题讲解	课后作业#1、期末项目		课程目标2、3、4、5
	第七章	虚拟变量的设置方法；虚拟变量作为被解释变量出现的计量模型的估计和解释	掌握根据问题分析需要设置虚拟变量的方法；理解虚拟变量作为被解释变量出现的计量模型	5	课堂讲授、习题讲解	课堂练习#4、期末项目		课程目标2、3、4
	第八章	时序环境下重述经典假定；对经典假定的弱化；序列相关问题	了解时序数据的特点；掌握针对上述特点的建模方法	3	课堂讲授、习题讲解	课堂练习#4、期末项目		课程目标3、4
	第九章	面板数据的三种假设；面板数据模型的应用	理解面板数据模型的应用；掌握利用计量分析软件处理面板数据的方法	6	课堂讲授、习题讲解	课后作业#2、期末项目		课程目标3、4、5
注1：建议按照教学周周学时编排，以便自动生成教学日历。 注2：相应章节的课程思政融入点根据实际情况填写。								
课程目标达成度评价 (选填, 非必填项)	课程目标 考核方式			平时作业 (20分)	课程项目 (30分)	期末考试 (50分)	课程目标权重	课程目标达成度

*考核方式 (Grading)	平时成绩 70%，期末项目（综合算例实现及报告）30% 平时成绩由以下构成： （1）考勤+课堂表现 10% （2）课堂练习 40% （3）课后作业（综合算例）20%						
*教材或参考资 料 (Textbooks & Other Materials)	（必含信息：教材名称，作者，出版社，出版年份，版次，书号） J. M. 伍德里奇，计量经济学导论：现代观点. 第 6 版， 中国人民 大学出版社. 2018 年 8 月，ISBN: 9787300259147						
其它 (More)							
备注 (Notes)							

备注说明：

1. 带*内容为必填项。
2. 课程简介字数为 300-500 字；课程大纲以表述清楚教学安排为宜，字数不限。