

厦门大学本科课程教学大纲

课程名称	计量经济学		
英文名称	Econometrics		
课程编号		学分/周学时	3/4
课程类型	必修课		
先修课程	经济学 高等数学 概率论 数理统计学		
选用教材	《Introductory Econometrics: A Modern Approach》5 Edition by Wooldridge		
主要参考书	《计量经济学基础》(第五版) 古扎拉蒂 《Introduction to Econometrics》3 Edition by Stock and Watson		
一、课程性质、目的与任务			
<p>本课程是一门利用经济理论、数学、统计推断等工具对经济现象进行分析的社会科学。</p> <p>本课程的教学目的与任务是，掌握计量经济学的基本内容，熟练计量经济学的应用研究步骤：建立模型、收集数据、参数估计、假设检验和模型预测。通过上机实践，掌握一种计量软件包。</p>			
二、教学基本要求			
<ol style="list-style-type: none"> 1. 了解计量经济学的特性和研究范围。 2. 介绍经济计量学的基本分析工具，对古典线性回归模型有一个完整的理解，使学生初步具备进行经济、商业、金融等领域的研究能力。 3. 介绍回归分析在实践中的运用，并讨论当古典线性回归模型的假设不满足时须解决各类问题。 4. 其它相关问题：模型的函数形式、虚拟变量、数据问题。 			
三、主要内容及学时安排			
章(或节)	主要内容	学时安排	
Ch 1	The Nature of Econometrics and Economic Data	2	
Ch 2	The Simple Regression Model	6	
Ch 3	Multiple Regression Analysis: Estimation	8	
Ch 4	Multiple Regression Analysis: Inference	8	
Ch 5	Multiple Regression Analysis: OLS Asymptotics	4	
	习题课、期中考	4	
Ch 6	Multiple Regression Analysis: Further Issues	6	
Ch 7	Binary (or Dummy) Variables	6	
Ch 8	Heteroskedasticity	4	

Ch 9	More on Specification and Data Issues	4
	习题课、答疑	4
合计		56
四、考核方式：闭卷考试		
五、开课专业：经济学院所有专业		
六、大纲制定者：元惠萍 大纲审定者：		
七、大纲制定时间：2017年2月12日		