

## 双学位课程介绍：

### 中级计量经济学 2 班——2015 年秋季学期双学位课程介绍

## 任课教师：

张丹丹

上课时间： 周四， 17:40--19:30； 周五, 17:40--19:30； 习题课： 周五， 19:40--21:30

上课地点： 周四： 二教 203

联系方式： Email: [ddzhang@nsd.pku.edu.cn](mailto:ddzhang@nsd.pku.edu.cn)

办公室： 国发院 106 室 电话： 62759779

答疑时间： 周一下午 2:00-4:00 或预约。

期中考试： **10 月 29 日（四）** 期末考试： **12 月 25 日（五）**

## 助教：

熊婉茹 [xiongwanyu@pku.edu.cn](mailto:xiongwanyu@pku.edu.cn)

陈子浩 [chenzh93@pku.edu.cn](mailto:chenzh93@pku.edu.cn)

吕伟聪 [davidlvweicong@sina.com](mailto:davidlvweicong@sina.com)

先修课要求： 微积分、线性代数、概率统计

## 教科书：

*Introductory Econometrics: A Modern Approach*, Jeffery M. Wooldridge, Fifth Edition, 2014.

[Jeffery M. Wooldridge, 计量经济学导论：现代观点（第 5 版）（清华经济学系列英文版教材），清华大学出版社，2014 年 1 月]

## 课程简介：

计量经济学探讨用统计技术研究经济数据的方法，目的是通过对微观数据的分析寻找经济学问题的因果解答。本课程的教学内容包括经典普通最小二乘法、多元线性回归模型、工具变量方法、和面板数据分析方法等。本课注重培养利用统计软件（STATA）实际操作微观数据并分析现实经济问题的能力。通过这门课的学习，学生们将初步掌握如何进行实证研究，以及如何评判实证研究中存在的问题。

## 教学目的：

通过这门课的学习，学生们将能够解释并使用数学公式表达计量模型，阐述计量分析中可能存在的问题，使用计量软件 STATA 分析微观数据，解释回归结果并进行必要的统计检验。

评分标准： 平时作业： 16%； 课堂参与： 4%； 期中考试： 30%； 期末考试： 50%

## 说明：

1. 评分标准构成不会调整。期末总成绩不调分。
2. 课堂参与采用课堂小调查方式。
3. 作业共四次，都计入总分。作业需在截止日期上课前交给助教。过时再交的作业当次

成绩计零分。如果对作业批改存在疑义，可在拿到作业一周内申诉。

4. 鼓励同学完成作业时互相讨论，但若发现抄袭，抄袭者和被抄袭者**所有**作业成绩计零分。
5. 考试方式为闭卷考试，试卷语言为英文，答题中英文皆可。考试日期不调整，缺考则当次考试成绩计零分，无补考。

### 课程安排：

周次	日期	课程内容	作业	习题课
第一周	17/09/2015 (四)	第一讲：课程内容介绍		
	18/09/2015 (五)	第二讲：统计回顾 (1)		
第二周	24/09/2015 (四)	第二讲：统计回顾 (2)		
	25/09/2015 (五)	第三讲：简单回归模型 (1)	作业 (1) 发布	Stata 软件介绍
第三周	01/10/2015 (四)	<b>十一休假，停课</b>		
	02/10/2015 (五)	<b>十一休假，停课</b>		
第四周	08/10/2015 (四)	第三讲：简单回归模型 (2)		
	09/10/2015 (五)	第四讲：多元回归模型的估计(1)	作业 (1) 上交	Stata 软件介绍
第五周	15/10/2015 (四)	第四讲：多元回归模型的估计(2)		
	16/10/2015 (五)	第四讲：多元回归模型的估计(3)	作业 (2) 发布	作业 (1) 讲解
第六周	22/10/2015 (四)	第五讲：多元回归模型的推断(1)		
	23/10/2015 (五)	第五讲：多元回归模型的推断(2)	作业 (2) 上交	期中复习+作业 (2) 讲解
第七周	29/10/2015 (四)	<b>期中考试</b>		
	30/10/2015 (五)	Stata 实证演练课 (助教讲解)		
第八周	05/11/2015 (四)	第六讲：多元回归模型的其它问题(1)		
	06/11/2015 (五)	第六讲：多元回归模型的其它问题(2)		期中试题讲解
第九周	12/11/2015 (四)	第七讲：虚拟变量 (1)		
	13/11/2015 (五)	第七讲：虚拟变量 (2)	作业 (3) 发布	
第十周	19/11/2015 (四)	第七讲：虚拟变量 (3)		
	20/11/2015 (五)	第八讲：异方差 (1)	作业 (3) 上交	
第十一周	26/11/2015 (四)	第八讲：异方差 (2)		
	27/11/2015 (五)	第九讲：模型设定和数据 (1)		作业 (3) 讲解
第十二周	03/12/2015 (四)	第九讲：模型设定和数据 (2)		
	04/12/2015 (五)	第十讲：工具变量 (1)	作业 (4) 发布	时间序列讲解
第十三周	10/12/2015 (四)	第十讲：工具变量 (2)		
	11/12/2015 (五)	第十一讲：合并的截面数据和面板数据(1)	作业 (4) 上交	
第十四周	17/12/2015 (四)	第十一讲：合并的截面数据和面板数据(2)		
	18/12/2015 (五)	期末复习		作业 (4) 讲解
第十五周	25/12/2015 (五)	<b>期末考试</b>		