

厦门大学研究生课程教学大纲范本

开课学院/研究院	经济学院	授课学期	2018-2019 春季学期
课程名称	高级计量经济学 (2)		
课程英文名称	<i>Advanced Econometrics II</i>		
*课程编码	050010005	面向对象	2018 级硕博
先修课程或 预备知识要求	Calculus, Linear Algebra, Probability & Statistics, Advanced Econometrics I		
课程学科分类	<input checked="" type="checkbox"/> 一级学科课程 <input type="checkbox"/> 二级学科课程 <input type="checkbox"/> 研究方向课程		
课程内容分类 (可多选)	<input checked="" type="checkbox"/> 理论讲授类 <input type="checkbox"/> 实验类 <input type="checkbox"/> 实务或实践类 <input type="checkbox"/> 研究方法类 <input type="checkbox"/> 研讨类 <input type="checkbox"/> 文献类 <input type="checkbox"/> 其他_____ (请注明)		
总学分/总学时	3/56	实践(含实验)学时	
任课教师	韩晓祎, 许杏柏, 谢天	联系方式	
助教		联系方式	
中文课程简介 (Course description in Chinese)	<p>对此门课程要达到的教学目标的描述和分析, 体现教师的教学理念。300-500 字为宜。</p> <p>本课程从一个统一的框架出发, 由浅入深, 循序渐进地讨论了各种计量经济学模型的估计方法, 并重点关注如何推导一些基本的计量经济学模型估计量的大样本性质, 以及如何进行假设检验和模型选择。本课程讨论的计量经济学模型不仅包括在不同设定下(独立同分布样本, 时间序列等)的最基本的线性回归模型, 还包括了微观计量经济学中的许多非线性模型。所关注的估计方法既包括最基本的最小二乘方法, 也包括了广义矩估计方法和极大似然估计方法。</p> <p>本课程力求让学生理解掌握计量经济学模型相关的基本概念, 以及教会学生如何运用模型和不同的估计方法进行规范的实证分析。本课程的重点以计量模型的假设和模型估计量的大样本性质为主, 实证分析为辅。重点不在于教会学生如何用某一种计量经济学分析软件来做实证分析, 而在于让学生深刻理解不同计量模型的假设和估计方法的理论性质, 并帮助学生更好地理解实证结果。</p>		

<p>英文课程简介 (Course description in English)</p>	<p>Describe the teaching aims of this course, and state your teaching ideas and philosophy. 300-500 words are recommended.</p> <p>This course covers various econometrics models and related methods, from conditional means to possibly nonlinear conditional moments to the entire conditional distributions, in a unified and coherent framework. A brief review of asymptotic analytic tools and how they are used to develop the econometric theory, are also provided in each chapter. By going through the course material, students will learn how to do asymptotic analysis for econometric models, and will be able to understand more specialized or more advanced econometrics textbooks.</p>
<p>课程内容与预期成果 (Course content & Expected Learning Outcomes)</p>	<p>列出课程的内容概要和计划进度。 列出任课教师希望通过此门课程达到的学习成果, 包括掌握知识/技能层面、发展能力层面、培养态度和价值观层面等。</p> <p>Week 1-2 Chapter 1 Introduction to Econometrics Chapter 2 General Regression Analysis Week 2-5 Chapter 3 Classical Linear Regression Models Chapter 4 Linear Regression Models with I. I. D. Observations Week 5-8 Chapter 5 Linear Regression Models with Dependent Observations Chapter 6 Linear Regression Models under Conditional Heteroskedasticity and Autocorrelation Week 8 Midterm Week 9-10 Chapter 7 Instrumental Variables Regression Week 10-12 Chapter 8 Generalized Method of Moments Estimation Week 12-14 Chapter 9 Maximum Likelihood Estimation and Quasi-Maximum Likelihood Estimation Week 15 Final exam week</p>

<p style="text-align: center;">教学方式 和学习活动 (Teaching and learning activities)</p>	<p>列出教师的教学方式和计划开展的学习活动内容，应与前列课程目标和预期学习成果相对应。</p>
<p style="text-align: center;">考核方式 Assessment Criteria</p>	<p>明确列出每一种考核方式的权重及评价标准，并说明对学术诚信的具体要求和核查措施。 下表供参考，教师可根据自身课程情况进行设计。</p> <p>期末 50%，期中 40%，平时成绩 10%</p>

<p style="text-align: center;">学习资源 (Learning Resources)</p>	<p>包括教材、参考书、参考文献，以及其他获取课程学习资源的途径等。</p> <p>Required textbook: Advanced Econometrics: A Unified Approach. By Prof.Yongmiao Hong,2017</p> <p>洪永淼教授开设的视频精品公开课《高级计量经济学》</p> <p>洪永淼著《高级计量经济学》,高等教育出版社 2011</p>
<p style="text-align: center;">备注</p>	<p>凡表格以上部分无法涵盖、教师认为需要说明的问题，请在此列出。</p>

*新开设课程可不填写课程编码，同意开设后由教学秘书编码并填入本表。

注：凡授课对象含海外学生的课程必须同时提供本表中所有内容的英文版本。