辽宁大学2021年招收攻读博士学位研究生(普通招考方式)

初试科目考试大纲

科目代码：3015

科目名称：计量经济学

满分：100分

数量经济学专业下设两个研究方向：计量经济学模型与方法与宏观经济计量分析，根据研究方向专业理论基础需要，故拟定专业课《计量经济学》入学考试大纲如下：

一、计量经济学概论部分

1.1 计量经济学的涵义、特点及其发展史

计量经济学的概念、特点、发展史

1.2 计量经济学研究内容范畴

计量经济学模型体系、建模方法体系、模型检验

1.3 计量经济学与相关学科的关系

计量经济学与数理统计学、数理经济学、经济统计学关系

1.4　计量分析的建模程序与成功要素

数据、理论、方法

1.5 计量经济学在经济研究中的应用

经济预测、结构分析、政策评价

1.6 计量经济模型方法与经济经验实证分析

实证分析内涵、理论实证分析与经验实证分析、实证分析程序、计量经济分析与经验实证分析的关系

二、 线性回归模型计量分析

2.1 线性回归模型一般形式

一般形式、随机扰动项、双线性特点

2.2 线性回归模型设定与建模的前提假设条件

设定前提假设条件，建模的经典、非经典前提假设条件

2.3 线性回归模型前提假设条件的检验

线性性、均值性、方差性、自相关性、正态性、多重共线性检验

2.4 线性回归模型建模的估计与检验

球面扰动下的法,非球面扰动下的、法，多重共线性下的建模法，非正态扰动下的建模法，随机解释变量下法，非线性回归模型建模法，虚变量回归模型建模法，特殊线性回归模型建模法

2.5 线性回归模型设定偏误

模型线性形式设定偏误，多余和遗漏解释变量，扰动项设定偏误

2.6 线性回归模型用于经济实证分析

比较静态学、弹性、乘数结构分析，经济预测分析，政策模拟分

析，验证和发展经济理论

三、自回归滑动平均模型计量分析

3.1 自回归滑动平均模型及其相关分析

模型形式, 序列的相关分析

3.2 自回归滑动平均模型前提假设条件及检验

模型设定与建模前提假设条件, 模型前提假设条件的检验

3.3 自回归滑动平均模型的参数估计与建模

序列的参数矩估计，模型参数的矩估计、估计、估计，模型的识别与定阶、拟合优度检验

3.4 自回归滑动平均模型的线性最小方差预测

模型的最小方差预测，模型预测分析程序

3.5 单整、自回归求和滑动平均模型及其预测

单整及其检验方法，模型及其预测分析

四、滞后变量模型、协整与均衡分析

4.1 滞后效应与滞后变量模型一般形式

滞后效应,模型的一般形式,产生机制分析

4.2 滞后变量模型前提假设条件、检验及建模

模型的前提假设条件及检验,模型的定阶方法,参数估计与建模

4.3 滞后变量模型的乘数与政策滞后效应分析

滞后变量模型的乘数分析,政策滞后效应分析

4.4 协整理论、误差修正模型与均衡分析

伪回归问题，协整理论及其检验，模型及其建模，协整与均衡分析

五、联立方程模型计量分析

5.1 联立方程模型的一般形式及前提假设条件

联立方程模型的一般形式，联立方程模型的设定，模型设定的前提假设条件及统计检验

5.2 联立方程模型的识别

联立方程模型识别的涵义，联立方程结构式模型识别方法

5.3 联立方程模型的建模方法

联立方程结构式模型单方程、联立方程建模方法

5.4 联立方程模型的结构分析和经济预测

联立方程模型的结构分析、经济预测

5.5 联立方程模型的政策模拟分析与效应评价

经济政策评价的内涵、特征和作用，经济政策评价原理、原则和，标准，经济政策评价内容与流程，经济政策评价的联立方程模型和方法

六、向量自回归模型与向量误差修正模型计量分析

6.1 向量自回归模型计量分析方法

模型的一般形式，模型的参数Yule-Walker、估计， 模型的预测，模型的定阶，

6.2 向量自回归模型的Granger因果关系检验

Granger因果关系涵义、Granger因果关系检验

6.3模型的脉冲响应函数与方差分解

脉冲响应函数、方差分解

6.4 Johansen协整检验与向量误差修正模型()

Johansen协整检验，向量误差修正模型()

七、面板数据（panel data）模型计量分析

7.1面板数据模型及其检验

变截距面板数据模型、变参数面板数据模型；固定效应面板数据模型、随机效应面板数据模型，面板数据模型的统计检验

7.2 变截距面板数据模型的参数估计

固定效应变截距面板数据模型的参数估计，随机效应变截距面板数据模型的参数估计，变截距面板数据模型的统计检验

7.3 变参数面板数据模型的参数估计

固定效应变参数面板数据模型的参数估计，随机效应变参数面板数据模型的参数估计

7.4 动态面板数据模型的参数估计

动态面板数据模型的估计，动态面板数据模型的单位根检验