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：3005

科目名称： 经济计量学基础

满分：100分

**I、考试基本要求**

考生应全面、系统地理解经济计量学的基本理论，熟练掌握经济计量分析的基本方法和构造模型的基本技术，具备运用相关原理与方法分析和解决实际经济问题的能力。

**Ⅱ、考查内容**

1、 经典线性回归模型的基本思想、参数估计方法、假设检验的构造；经典线性回归模型的主要性质

2、 异方差、序列相关、多重共线性的后果、诊断以及处理方法；模型设定和诊断检验

3. 虚拟变量回归模型；非线性回归模型；定性响应回归模型；面板数据回归模型；自回归与分布滞后模型、经济学中的因果性与格兰杰检验

4. 伪回归问题；平稳性检验、协整与误差修正模型；ARIMA模型与VAR模型

5. 联立方程模型的性质、联立方程模型的识别和估计方法