2024年硕士研究生入学考试自命题考试大纲

**考试科目代码：[F006] 考试科目名称：计量经济学**

**一、试卷结构**

1、试卷成绩及考试时间

本试卷满分为150分，考试时间为120分钟

2、答题方式：闭卷、笔试

3、题型结构

**名词解释题**：6小题，每小题5分，共30分

**单 选 题：**10小题，每小题2分，共20分

**简 答 题**：4小题，每小题15分，共60分

**计算分析题**：2小题，每小题20分，共40分

**二、考试内容**

（一）导论

1、什么是计量经济学

2、计量经济学的研究步骤

3、变量、参数、数据与模型

（二）简单线性回归模型

1、回归分析与回归函数

2、简单线性回归模型参数的估计

3、拟合优度的度量

4、回归系数的假设检验和区间估计

5、回归模型的预测

（三）多元线性回归模型

1、多元线性回归模型及古典假设

2、多元线性回归模型的估计

3、多元线性回归模型的假设检验和区间估计

4、多元线性回归模型的预测

（四）多重共线性

1、完全多重共线性、近似多重共线性的基本定义

2、多重共线性的来源和后果

3、多重共线性检验及其应用

4、多重共线性的解决方法

（五）异方差性

1、同方差、异方差的基本定义

2、异方差的来源和后果

3、异方差检验

4、异方差的修正

（六）自相关

1、非自相关、自相关的基本定义

2、自相关的来源和后果

3、自相关检验

4、自相关的解决方法。广义最小二乘法的基本原理及其应用

（七）分布滞后模型与自回归模型

1、滞后效应与滞后变量模型

2、分布滞后模型的估计

3、自回归模型的构建

4、自回归模型的估计

（八）虚拟变量回归

1、虚拟变量

2、虚拟解释变量的回归

3、虚拟被解释变量

（九）设定误差与测量误差

1、设定误差类型及后果

2、设定误差的检验

3、测量误差

（十）时间序列计量经济模型

1、时间序列计量经济分析的基本概念

2、时间序列平稳性的单位根检验

3、协整

4、格兰杰因果检验

**三、参考书目**

计量经济学（第四版），庞皓主编，北京：科学出版社，2019.