

《计量经济学》考试大纲概述：内容主要有一元及多元线性回归模型的参数估计和检验、异方差、自相关、多重共线性等问题的诊断和处理、联立方程模型、时间序列分析等。测试学生对计量经济学的基本概念、基本原理和方法的掌握程度，了解其是否具有初步应用这些基本原理和方法分析有关问题的能力。

第一章 计量经济学概论

- 第一节 什么是计量经济学
- 第二节 计量经济模型与数据
- 第三节 计量经济学研究的一般方法
- 第四节 计量经济学软件 EViews 简介
- 第五节 计量经济学软件 EViews 的基本概念

第二章 一元线性回归模型

- 第一节 回归分析的几个基本问题
- 第二节 一元线性回归模型
- 第三节 一元线性回归模型正态条件下的假设检验
- 第四节 一元线性回归模型的预测
- 第五节 EViews 软件应用实例

第三章 多元线性回归模型

- 第一节 多元线性回归模型的几个基本问题
- 第二节 偏回归系数的最小二乘估计
- 第三节 参数估计量和随机扰动项的方差估计
- 第四节 多元线性回归模型的假设检验
- 第五节 多元线性回归模型用于预测
- 第六节 回归模型的其他函数形式

第四章 异方差

- 第一节 异方差的性质
- 第二节 异方差的后果
- 第三节 异方差的检验
- 第四节 异方差的修正方法

第五章 自相关

- 第一节 自相关的性质
- 第二节 自相关产生的原因
- 第三节 自相关的后果
- 第四节 自相关的诊断
- 第五节 补救措施
- 第六节 广义差分法的应用

第六章 多重共线性

- 第一节 多重共线性的概念
- 第二节 多重共线性的后果
- 第三节 多重共线性的检验
- 第四节 多重共线性问题的处理
- 第五节 实例：多重共线性的检验与模型估计

第七章 滞后变量模型

- 第一节 滞后变量模型的概念
- 第二节 分布滞后模型的估计
- 第三节 自回归模型的构造
- 第四节 自回归模型的估计
- 第五节 格兰杰因果关系检验
- 第六节 实例：滞后变量模型的估计

第八章 虚拟变量模型

- 第一节 虚拟变量模型的概念
- 第二节 变截距的虚拟解释变量模型
- 第三节 变斜率的虚拟解释变量模型
- 第四节 实例：虚拟解释变量模型的估计

第九章 联立方程模型

- 第一节 联立方程模型概述
- 第二节 联立方程模型的识别
- 第三节 联立方程模型的估计
- 第四节 实例：联立方程模型的估计

第十章 时间序列计量经济模型

- 第一节 时间序列计量经济分析概述
- 第二节 时间序列的平稳性检验
- 第三节 协整分析与误差修正模型
- 第四节 实例：协整检验与误差修正模型的估计