**中国地质大学（武汉）**

**硕士研究生入学考试《计量经济学》考试大纲**

**一、考试方式**

 闭卷，笔试，可携带计算器

**二、试卷满分及时间**

 满分100分，考试时间120分钟

**三、题型结构**

 1. 选择题（20分）

 2. 判断题（10分）

 3. 简答计算题（50分）

 4. 综合案例题（20分）

**四、考查目标**

《计量经济学》融计量经济学理论、方法与应用为一体，考查内容包含经典的单方程计量经济学模型的理论方法，包括一元线性回归模型、多元线性回归模型和放宽基本假定的单方程计量经济学模型，以及计量经济学基本模型的应用。要求考生系统掌握计量经济学的基本知识、基础理论和基本方法，并能运用相关理论和方法，分析解决现实经济问题。

**五、考查要点**

（一）计量经济学相关概念

1. 回归的含义

2. 统计关系、回归关系与因果关系

3. 数据类型及其来源

4. 总体回归函数与样本回归函数

5. 线性的含义

6. 随机干扰项及残差的含义

（二）经典线性回归模型的估计及假设推断

1 .OLS参数估计

（1）普通最小二乘原理

（2）OLS估计量的BLUE性质

（3）CLRM的基本假定

（4）判定系数与调整的判定系数

（5）扰动项的正态假定

2. 推断与假设检验

（1）单个系数的T检验

（2）方差的卡方检验

（3）模型的F检验

（4）置信区间估计与检验

（5）均值预测与个值预测

3. 常见模型特征

（1）过原点回归

（2）尺度与测量单位对估计的影响

（3）对数模型与半对数模型

（4）倒数模型

4. 线性假设检验

（1）受约束最小二乘法

（2）邹至庄检验

5. 虚拟变量回归

（1）虚拟变量的定义及编码

（2）虚拟变量的引入方式

（3）虚拟变量的交互效应

（4）虚拟变量在季节分析以分段回归中的应用

（三）放松经典假定模型估计及假设推断

1. 异方差的性质、后果、诊断与补救

2. 多重共线性的性质、后果、诊断与补救

3. 自相关的性质、后果、诊断与补救

4. 模型设定偏误的性质、后果、诊断与补救

（四）时间序列基础

1. 平稳性的概念

2. 随机游走与单位根检验

3. 自相关函数与偏自相关函数

4. 白噪声

5. 协整与误差修正模型

6. ARIMA模型的识别与应用

**六、参考书目**

1.《计量经济学基础》（第五版），古扎拉蒂等，中国人民大学出版社

2.《计量经济学》（第四版），庞皓，科学出版社