



计量经济学II (Econometrics II)

胡华平

西北农林科技大学

经济管理学院数量经济教研室

huhuaping01@hotmail.com

2021-09-26

西北农林科技大学

part 00 课程说明

1.1 课程内容与分工

1.2 课程复习与回顾

1.3 课程安排与参考书

1.1 课程内容与分工



模块01：计量经济学基础

- 第01章 经典模型
- 第02章 矩阵分析
- 第03章 放宽假设
- 第04章 扩展方法

主讲教师：胡华平/白秀广 讲授学时数：8-12学时



模块02：时间序列数据建模

- 基本概念
- 预测建模（AR、MA、ARIMA）

主讲教师：冀昊

讲授学时数：8-12学时



课程内容与分工3

模块03：定性响应变量回归模型

- logit模型
- probit模型

主讲教师：田茂茜

讲授学时数：8-12学时



模块04：联立方程模型（SEM）

- 第17章 内生自变量问题
- 第18章 联立方程模型的问题和本质
- 第19章 联立方程模型的识别
- 第20章 联立方程模型的估计

主讲教师：胡华平/朱玉春 讲授学时数：8-12学时

1.2 课程复习与回顾



计量经济学语言

计量经济学本身就是一门语言。？ 胡华平

- 计量经济学的那点调性和套路
- 计量经济学语言1（母语）：术语、符号和概念（见本科第2章课件）
- 计量经济学语言2（暗语）：回归报告和分析结果（见本科第4章课件）
- 计量经济学语言3（狂语）：矩阵matrix（见本科第6章课件）

1.3 课程安排与参考书



课时安排 (模块1)

模块01：计量经济学基础

- 第01章 经典模型 (3学时)
- 第02章 矩阵分析 (1学时)
- 第03章 放宽假设 (5学时)
- 第04章 扩展方法 (3学时)



课时安排 (模块4)

模块04 联立方差模型

- Chapter 18. (4学时) 为什么要关心联立方程模型?
- Chapter 19. (4学时) 联立方程模型的识别问题
- Chapter 20. (4学时) 联立方程模型的估计方法



参考教材

联立方程模型（SEM）模块主要参考如下教材：

- Hill, R. C., W. E. Griffiths and G. C. Lim. Principles of Econometrics 5ed [M], Wiley&Sons, 2017. 第10章（内生自变量）。
- Gujarati, D. and D. Porter. Basic Econometrics (5ed) [M], McGraw-Hill Education, 2008. 第18章、19章、20章。简单通俗！
- Wooldridge, J. M. Introductory econometrics. A modern approach(6ed) [M], Cengage Learning, 2016. 第16章。简单通俗！
- Greene, W. H. Econometric analysis(8ed) [M]. New York, Pearson, 2018. 第10章。高手级别，与博士接轨！
- Hansen B. Probability and Statistics for Economists[manuscript]. 2021. [free online](#)。气势恢宏，博士生慢慢啃吧。
- HANSEN B. Econometrics [manuscript]. 2021. [free online](#)。气势恢宏，博士生慢慢啃吧。

本章結束

