

经济学综合（微、宏观及计量经济学）考试大纲

总分 150 分，其中微、宏观经济学约占 80%，计量经济学约占 20%。

第一部分：《微观经济学》

一、考试目的

本次考试是南开大学金融学院各专业全日制学术型研究生的入学资格考试之微观经济学部分。

二、考试的性质与范围

微观经济学考试主要测试考生是否理解和掌握微观经济学的基本概念、基本原理和基本方法，是否能够运用相关知识和原理分析问题和解决问题，达到甄别优秀考生以进一步学习金融学的目的。考试范围包括本大纲规定的微观经济学考试内容。

三、考试基本要求

要求考生熟悉基本概念和定理，并系统、深入理解整个微观经济理论的框架和内在逻辑，熟练掌握微观经济学的主要分析方法、工具和手段，理论联系实际，准确、恰当地使用微观经济学专业术语，文字通顺、层次清晰、合乎逻辑地表述和分析经济问题。考生统一用中文答题。

四、考试形式

考试形式采用闭卷考试。试卷结构采用如下题型范围：名词解释题、简答题、计算题和论述题等。

五、考试内容

考试重点内容如下

1. 预算约束：预算约束的定义、预算集的性质、预算线的变动、税收、补贴和配额等经济工具对预算线的影响

2. 偏好：偏好的定义、偏好的假设、无差异曲线、边际替代率、良态偏好的定义性特征
3. 效用：效用函数的单调变换、构造效用函数、拟线性偏好、边际效用和边际替代率的关系
4. 选择：消费者的最优选择、需求函数
5. 需求：正常商品和低档商品、收入提供曲线和恩格尔曲线、相似偏好、普通商品和吉芬商品、价格提供曲线和需求曲线、替代品和互补品、反需求函数
6. 显示偏好：显示偏好的概念、从显示偏好到偏好
7. 斯勒茨基方程：价格变动的替代效应和收入效应、希克斯替代效应
8. 需求分析和跨期选择问题：禀赋和需求变动、修正的斯勒茨基方程、劳动供给、跨期选择的预算约束
9. 不确定性条件下的选择：或有消费、期望效用、风险厌恶、风险偏好、风险中性
10. 消费者剩余：消费者剩余的概念、补偿变化和等价变化
11. 市场需求：从个人需求到市场需求、弹性、弹性与收益、边际收益曲线、收入弹性
12. 均衡：市场均衡、比较静态分析、税收、税收的转嫁、税收的额外损失、税收与帕累托效率
13. 技术：投入和产出、生产函数、技术的特征、边际产品、技术替代率、边际产品递减、技术替代率递减、长期和短期、规模报酬
14. 利润最大化：利润、不变要素和可变要素、短期利润最大化、长期利润最大化、反要素需求曲线、利润最大化和规模报酬
15. 成本最小化：成本最小化的定义、规模报酬和成本函数、长期成本和短期成本、沉没成本
16. 成本曲线：各种成本概念、各种成本之间的关系
17. 厂商供给和行业供给：市场特征、反供给函数、利润和生产者剩余、短期行业供给和长期行业供给、零利润、不变要素和经济租金、寻租
18. 垄断和垄断行为：垄断的定义、线性需求曲线和垄断、成本加成定价、垄断的低效率、自然垄断、价格歧视的定义、三种价格歧视

19. 要素市场：边际产品收益和边际产品价值、产品市场垄断厂商的要素需求、要素市场买方垄断的要素需求、上游垄断和下游垄断
20. 寡头垄断：寡头垄断特征与模式、古诺模型、斯塔克尔伯格模型、伯特兰竞争模型、价格领导者模型、联合定价和串谋
21. 博弈论：博弈的收益矩阵、纳什均衡、混合策略、囚徒困境、重复博弈、序贯博弈
22. 交换经济和福利经济学定理：埃奇沃思方框图、契约曲线、瓦尔拉斯法则、均衡定义与均衡的存在性、福利经济学基本定理
23. 生产经济与福利经济学定理：鲁滨逊·克鲁索经济、生产与福利经济学第一定理、生产与福利经济学第二定理
24. 外部效应：外部性的定义与表现形式、庇古税与科斯定理、公地的悲剧
25. 公共物品：公共物品的定义、搭便车、公共物品的需求和供给
26. 不对称信息：逆向选择、道德风险、委托代理问题和激励

第二部分：《宏观经济学》

一、考试目的

本次考试是南开大学金融学院各专业全日制学术型研究生的入学资格考试之宏观经济学部分。

二、考试的性质与范围

宏观经济学考试主要是测试考生是否理解和掌握宏观经济学的基本概念、基本原理和基本方法，能否运用相关知识和原理联系实际，具备分析问题和解决问题的能力的基本能力，是测试考生宏观经济学知识的尺度参考性水平考试。考试范围包括本大纲规定的所有内容。

三、考试基本要求

1. 具备宏观经济学的理论知识，理解整个宏观经济学的框架和内在逻辑。
2. 具备运用宏观经济学知识分析现实问题，理论联系实际的能力。
3. 试卷统一用中文答卷。

四、考试形式

本考试采取客观试题与主观试题相结合，单项技能测试与综合技能测试相结合的方法。主要的试题类型有：简答题、计算题和论述题等。

五、考试内容

本考试包括以下 13 部分内容。

1. 宏观经济学的概念、研究内容与研究方法

2. 国民收入

- (1) 国内生产总值及其核算方法
- (2) 与国民收入相关的其它几个概念
- (3) 产品与服务的供给与需求
- (4) 国民收入如何分配

3. 货币与通货膨胀

- (1) 货币
- (2) 货币供给、货币需求和银行体系
- (3) 通货膨胀与利率
- (4) 通货膨胀的社会成本
- (5) 货币数量论与古典二分法

4. 失业与工资

- (1) 失业率
- (2) 失业的原因
- (3) 劳动力的供给与需求
- (4) 工资刚性与结构性失业

5. IS-LM 模型

- (1) 产品市场与 IS 曲线
- (2) 货币市场与 LS 曲线
- (3) IS-LM 模型
- (4) IS-LM 模型的应用

6. 总需求-总供给模型

- (1) 总供给曲线
- (2) 总需求曲线
- (3) 总需求-总供给模型
- (4) 总需求-总供给模型的应用
- (5) 总供给理论
- (6) 菲利普斯曲线
- (7) 总供给-总需求的动态模型

7. 开放经济

- (1) 产品和资本的国际流动
- (2) 小型开放经济中的储蓄与投资
- (3) 蒙代尔-弗莱明模型
- (4) 不同汇率制度下宏观经济政策对均衡的影响

8. 经济增长理论

- (1) Solow 增长模型
- (2) 内生增长理论
- (3) 资本积累、人口增长、技术进步在经济增长中的作用
- (4) 增长政策

9. 经济周期理论

- (1) 经济周期的定义与特征
- (2) 古典经济周期理论
- (3) 凯恩斯主义经济周期理论
- (4) 关于经济波动来源的争论

10. 消费理论

- (1) 凯恩斯的消费函数及相对收入假说
- (2) 费雪的跨期选择模型
- (3) 生命周期假说
- (4) 永久收入假说
- (5) 消费的随机游走假说

11. 投资理论

- (1) 新古典投资模型
- (2) 住房投资和库存投资

12. 宏观经济政策

- (1) 货币政策目标、工具及局限性
- (2) 货币政策规则
- (3) 财政政策的挤出效应
- (4) 政府债务的规模及其对经济的影响

13. 主要宏观经济学派的主要观点、争论与共识

第三部分：《计量经济学》

一、考试目的

本考试是南开大学金融学院各专业学术型研究生的入学资格考试之计量经济学。

二、考试的性质与范围

计量经济学考试主要是测试考生是否理解和掌握计量经济学（包括理论计量经济学和应用计量经济学）的基本理论和主要模型设定方法，能否运用相关知识和定量分析方法，解决实际经济生活中有关经济学问题的能力。本考试是测试考生计量经济学知识的尺度参考性水平考试，考试范围包括本大纲规定的所有内容。

三、考试基本要求

1. 掌握计量经济学的基本概念、理论和方法。
2. 熟悉计量经济分析工作的基本内容和工作程序。
3. 具备建立与应用计量经济学模型的能力。
4. 熟练运用计量经济学的相关软件。
5. 了解计量经济学方法的应用领域和最新发展情况。
6. 试卷用中文答卷。

四、考试形式

本考试采用闭卷考试形式。采取客观试题与主观试题相结合，单项技能测试与综合技能测试相结合的方法。主要的试题类型有：单项选择题、判断题、简答题、计算题、证明题和论述题。

五、考试内容

本考试包括以下 13 个部分内容。

1. 计量经济学的基本概念、历史与发展现状、理论体系与研究方法、应用领域及其与各相关学科关系、建立计量经济模型的基本步骤

2. 经典线性回归模型

- (1) 线性回归模型的数学形式
- (2) 随机误差及其来源
- (3) 古典假定
- (4) 普通最小二乘 (OLS) 估计方法的数学原理
- (5) 普通最小二乘估计量 (OLSE) 的性质、最佳线性无偏估计的概念
- (6) 模型检验, 主要包括: 拟合优度检验、单个参数显著性的 t 检验、回归总显著性的 F 检验、随机误差项的正态性检验
- (7) 置信区间的概念、模型参数的置信区间
- (8) 点预测和区间预测
- (9) 经典线性回归模型的扩展: 过原点的线性回归模型、测量单位对估计结果的影响、可线性化的非线性回归模型 (多项式函数、双曲线函数、对数函数、指数函数、幂函数形式模型)

3. 异方差

- (1) 异方差的概念、来源及后果
- (2) 异方差条件下 OLSE 的性质
- (3) 检验异方差的方法: 图示检验法、怀特检验、戈里瑟检验
- (4) 异方差条件下的参数估计方法: 加权最小二乘法 (WLS)

4. 序列自相关

- (1) 序列自相关的概念、来源及后果

- (2) 序列自相关条件下 OLSE 的性质
- (3) 检验序列自相关的方法：图示检验法、德宾-沃森 (DW) 检验、拉格朗日乘子 (LM) 检验、回归检验
- (4) 序列自相关条件下的参数估计方法：广义差分变换、广义最小二乘法 (GLS)

5. 多重共线性

- (1) 多重共线性的概念、后果
- (2) 多重共线性条件下 OLSE 的性质
- (3) 多重共线性的检验
- (4) 多重共线性条件下的参数估计方法：逐步回归法、追加样本信息、剔除变量等

6. 随机解释变量

- (1) 随机解释变量的含义
- (2) 随机解释变量条件下的 OLSE 的性质
- (3) 工具变量的选择与工具变量法 (IV)

7. 虚拟变量

- (1) 虚拟变量的设定
- (2) 虚拟变量系数的含义
- (3) 虚拟变量的交互效应
- (4) 虚拟变量在季节分析中的应用

8. 分布滞后模型与自回归模型

- (1) 分布滞后模型的概念
- (2) 分布滞后模型的参数估计
- (3) 自回归模型
- (4) 自回归模型的参数估计

9. 模型设定与诊断检验

- (1) 模型误设的含义
- (2) 模型误设：遗漏重要解释变量、引入不相关解释变量、模型数学形式设定错误及其影响

- (3) 沃尔德 (Wald) 检验
- (4) 似然比 (LR) 检验
- (5) 拉格朗日乘子 (LM) 检验
- (6) 拉姆齐的回归误差设定 (RESET) 检验
- (7) 模型选择的准则

10. 联立方程计量经济模型

- (1) 联立方程偏倚、内生变量、外生变量、前定变量的概念
- (2) 结构模型、结构参数、简化模型、简化参数
- (3) 恰好识别、过度识别和不可识别的概念
- (4) 模型的识别条件：结构方程可识别的阶条件和秩条件
- (5) 模型的估计方法：间接最小二乘法 (ILS)、工具变量法 (IV)、两阶段最小二乘法 (2SLS)

11. 时间序列分析

- (1) 随机过程与时间序列
- (2) 平稳时间序列与非平稳时间序列
- (3) AR 过程与 MA 过程及其相互关系、ARMA 过程、ARIMA 过程
- (4) 自相关函数与偏自相关函数
- (5) 建立时间序列模型的基本步骤
- (6) 最大似然估计法
- (7) 模型的检验 (包括：Q 统计量、特征根位置、参数显著性) 与预测

12. 非平稳时间序列与协整

- (1) 单整的概念与单整时间序列的统计特征
- (2) 单位根检验与虚假回归的含义
- (3) 单位根检验方法：DF 检验、ADF 检验
- (4) 协整的含义
- (5) 格兰杰非因果性检验
- (6) 协整检验与 E-G 两步法
- (7) 单方程的误差修正模型

13. 面板数据模型

- (1) 面板数据、截面数据、时间序列数据的区别与联系
- (2) 面板混合估计模型、面板固定效应模型和面板随机效应模型的含义
- (3) 面板数据模型的主要估计方法有：混合最小二乘（Pooled OLS）估计、最小二乘虚拟变量（LSDV）估计、可行广义最小二乘（FGLS）估计等
- (4) 三种类型的面板数据模型的比较（F 检验和 Hausman 检验）
- (5) 面板数据模型估计结果的解释