

# 复旦大学经济学院博士研究生招生考试

## 3406 计量经济学应用考试大纲

### 一、考试要求

在熟练掌握计量经济学理论的基础上，着重考察对经济逻辑的思考和解决实际问题的能力。在实证分析中经常碰到的问题，如何用计量模型去识别，是考核的重点。

### 二、考试大纲

(一) 如何从实际问题归纳到计量模型。

(二) 线性模型的估计：截面数据、时间序列数据和面板数据模型的估计方法。

(三) 线性模型的检验：t 检验，F 检验，chow 检验，异方差和序列相关检验，豪斯曼检验等。

(四) 无偏性和一致性的概念与区别。

(五) 如何识别经济中存在的内生性问题以及解决的办法。

(六) 如何识别经济中自选择的问题以及解决的办法。

(七) 如何解决样本选择的问题以及解决的办法。

(八) 时间序列的应用

(九) 微观计量的应用