846经济学基础考试大纲

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **科目代码** | **科目名称** | **考   试   大   纲**（提纲式列举本科目须考查的知识要点） |
| 846 | 经济学基础 | **宏观、微观经济学部分**一、经济学研究对象与研究方法（一）经济学的研究对象（二）经济学的研究内容（三）经济学的研究方法二、需求、供给、弹性与均衡价格（一）需求理论（二）供给理论（三）均衡（四）弹性理论（五）蛛网模型三、消费者行为理论（一）效用、总效用与边际效用（二）边际效用递减规律与消费者剩余（三）无差异曲线与预算线、消费者效用最大化。（四）价格消费曲线与收入消费曲线（五）替代效应与收入效应（六）不确定性与选择四、生产者行为（一）厂商与生产函数（二）短期生产函数（三）长期生产函数（四）规模报酬五、成本理论（一）机会成本与经济利润（二）成本最小化（三）短期成本曲线（四）长期成本曲线六、完全竞争市场（一）划分市场结构的标准与市场结构类型（二）完全竞争市场假设、价格、需求曲线、收益曲线、利润最大化（三）完全竞争市场上的短期均衡与供给曲线。（四）完全竞争市场上的长期均衡与供给曲线（五）完全竞争市场的福利七、不完全竞争市场（一）完全垄断市场（二）垄断竞争市场（三）寡头市场八、生产要素理论（一）完全竞争厂商对生产要素的需求曲线（二）劳动的供给曲线（三）地租的决定（四）资本与利息（五）洛伦兹曲线与基尼系数九、一般均衡与福利经济学（一）瓦尔拉的一般均衡理论 （二）生产与交换的帕累托最优（三）完全竞争和帕累托最优（四）社会福利函数（五）效率与公平十、市场失灵与微观经济政策（一）不完全竞争（二）外部影响（三）公共物品与公共资源（四）信息的不完全与不对称十一、国民收入核算（一）国内生产总值与国民生产总值（二）GDP的核算（三）国民收入核算中的其他总量 十二、国民收入的决定：收入支出模型（一）凯恩斯的消费理论与消费函数 （二）两部门经济中国民收入的决定 （三）乘数理论 （四）三部门经济中国民收入的决定 （五）四部门经济中国民收入的决定 十三、国民收入的决定：IS—LM模型 （一）利率、资本的边际效率与投资 （二）产品市场的均衡：IS曲线 （三）货币市场的均衡：LM曲线 （四）产品市场与货币市场的同时均衡：IS—LM模型 十四、总需求总供给分析（一）总供给曲线（二）总需求曲线（三）总需求与总供给模型十五、失业与通货膨胀（一）失业（二）通货膨胀（三）失业与通货膨胀的关系-菲利普斯曲线十六、宏观经济政策（一）宏观经济政策概述（二）财政政策（三）货币政策（四）财政政策和货币政策的配合（五）供给管理政策十七、开放条件下的宏观经济学（一）汇率与国际收支（二）蒙代尔-弗莱明模型（三）南北经济分析十八、经济增长和经济周期（一）新古典增长模型（二）内生增长理论。（三）经济周期十九、宏观经济学的微观基础（一）消费（二）投资（三）货币需求二十、新古典宏观经济学和新凯恩斯主义经济学**建议参考以下教材：**高鸿业 西方经济学（微观部分、宏观部分）第六版中国人民大学出版社2016年4月**计量经济学部分：**1 单方程计量经济学模型：一元线性回归模型1.1 回归分析的基本概念：相关分析；线性相关；回归分析；因变量；自变量；总体回归函数；总体回归曲线；条件分布；条件均值；随机干扰项；样本回归函数；样本回归线；残差项。1.2 一元线性回归模型的基本假设：对模型设定的假设，对解释变量的假设，对随机干扰项的假设，外生解释变量，内生解释变量，同期外生，同期不相关，经典假设，经典线性回归模型，高斯-马尔可夫假设。一元线性回归模型的参数估计：最小二乘法（OLS）：最小二乘原理，正规方程组，离差形式，普通最小二乘估计量。最大似然法（ML）: 最大似然估计基本原理，似然函数，最大似然估计与最小二乘估计的关系。矩估计法（MM）：样本矩，总体矩。最小二乘估计量的统计性质：如何考察估计量的优劣性，有限样本性质，最佳线性无偏估计量（要求会证明），大样本渐近性质，经典线性回归假设下，最小二乘估计量具有的性质。参数估计量的概率分布及随机干扰项方差的估计。1.3 一元线性回归模型的统计检验：拟合优度的定义，总离差平方和的分解，离差平方和，回归平方和，可决定系数统计量及性质与意义，变量的显著性检验，点估计，区间估计，显著性水平，置信限或临界值，如何缩小置信区间。1.4 如何利用线性模型进行预测：预测值，预测值的置信区间。1.5 一元线性回归模型的应用。2 经典单方程计量经济学模型：多元线性回归模型2.1 多元线性回归模型：多元线性回归模型的形式，偏回归系数，多元线性回归模型的基本假设。2.2 多元线性回归模型的估计方法：最小二乘估计及其矩阵表达，正规方程组的推导，估计值的计算（要求会证明），参数的最大似然估计，随机干扰项方差的估计，参数估计量的统计性质（要求证明）。2.3 样本容量问题：最小样本容量，满足基本要求的样本容量。2.4 多元线性回归模型的统计检验：拟合优度检验，可决系数与调整的可决系数，赤池信息准则和施瓦茨准则及其应用，方程总体线性的显著性检验（F检验），变量的显著性检验（t检验），t检验与F检验的关系，参数的区间估计。2.5 多元线性回归模型的预测：点预测与区间预测。2.6 非线性模型的线性化变换方法。2.7 含有虚拟变量的多元线性回归模型：虚拟变量，虚拟变量的设置原则，虚拟变量陷阱。2.8 受约束回归：线性约束， 检验，F检验，根据统计量增加或减少解释变量（应用），检验不同组之间回归函数的差异，邹氏参数稳定性检验。3 经典单方程计量经济学模型：放宽基本假设的模型3.1 基本假定的违背的情形3.2 多重共线性：多重共线性，完全共线性，近似共线性，多重共线性的产生原因，多重共线性的后果，多重共线性的检验，如何克服多重共线性。3.3 异方差性：什么是异方差，异方差的类型，异方差的后果，异方差性的检验（图示检验，Breusch-Pagan检验，White检验），异方差的修正方法，加权最小二乘，广义最小二乘，异方差稳健性误法及其应用。3.4 内生解释变量问题：什么是内生解释变量问题及两种不同情况，实际经济问题中的内生解释变量问题。联立方程模型，内生解释变量的后果，工具变量法，工具变量的选取原则工具变量的应用，工具变量法估计量的计算（证明），工具变量法估计量的性质（证明），两阶段最小二乘法，多个工具变量情形。3.5 内生性检验与过度识别约束的检验：Hausman检验及其应用，过度识别约束检验：J统计量及其应用。3.6 模型设定偏误问题：模型设定偏误的类型，模型设定偏误的后果，模型设定偏误的检验。4 时间序列计量经济学模型4.1 时间序列模型的序列相关性：序列相关性的定义，自相关，自协方差系数，序列相关产生的原因，序列相关性的后果，序列相关检验方法，序列相关的补救，序列相关稳健性标准误法，虚假序列相关。4.2 时间序列的平稳性及其检验：为什么要检验时间序列的平稳性，随机时间时间序列（宽）平稳的定义，白噪音的定义，随机游走的定义，平稳性的判断，样本自相关函数，平稳性的单位根检验(DF检验，ADF检验)，单整时间序列的定义。4.3 协整与误差修正模型：长期协整关系，非均衡误差，协整向量，协整的检验（两变量，多变量，高阶单整变量的Engle-Granger检验），协整方程与均衡方程的差异，误差修正模型，格兰杰表述定理，Engle-Granger两步法，直接估计法。4.4 格兰杰因果关系检验：自回归模型，AR过程，MA过程，ARMA过程，AR(p)模型的平稳性条件，时间序列向量自回归模型的表达式，时间序列向量自回归模型的局限，格兰杰因果关系检验的应用。5 非经典截面数据计量经济学模型5.1 受限被解释变量模型、持续时间被解释变量模型。5.2 选择性样本计量经济学模型：“截断”问题和“归并”问题的含义及其区别，截断分布，截断被解释变量数据计量经济学模型的最大似然估计，为什么截断被解释变量数据计量经济学模型不能采用普通最小二乘估计，“归并”变量的正态分布，归并被解释变量数据计量经济学模型的最大似然估计。5.3 二元离散选择模型：Probit模型和Logit模型的参数估计。二元离散选择模型的拟合优度检验、总体显著性检验及回代效果检验。5.4 固定效应面板数据计量经济学模型：经典面板数据模型的类型，模型设定的F检验，固定效应变截距模型，固定效应变系数模型的估计。**建议参考以下教材：**《计量经济学》( 第四版)，高等教育出版社，李子奈，潘文卿 |