

淡江大學 100 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等應用計量	授課 教師	黃河泉 Ho-chuan Huang
	ADVANCE APPLIED ECONOMETRICS		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
系所教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
系所核心能力			
<ul style="list-style-type: none"> A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。 B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。 C. 熟稔相關財金研究方法與成果。 D. 具備獨立研究的學術能力。 E. 提升學生的教學能力。 F. 提升學術研究國際化之能力。 			
課程簡介	<p>本科目除了介紹一些於學術研究分析的基本方法外，並特別討論當前於實證分析中常用的進階模型與方法；同時，我們也會介紹一些相關的財金應用主題，讓學生能夠從中學習到如何找到適當研究題目、如何進行所需分析與如何撰寫並發表一篇正式論文。</p>		
	<p>This course first reviews some fundamental approaches for empirical research, and then proceeds to discuss more recent-advanced econometric techniques for finance. In particular, we will consider many empirical applications of those methods so that, during the course, students will be able to find some interesting topics, to conduct the empirical analysis and to write a decent academic paper for publication.</p>		

本課程教學目標與目標層級、系所核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系所核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應該系「系所核心能力」。單項教學目標若對應「系所核心能力」有多項時，則可填列多項「系所核心能力」(例如：「系所核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列)。

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系所核心能力
1	學生可以了解各種基本的計量方法，並進一步學習較新且有用之實證模型與其在財務領域之應用。	Students will be able to learn a variety of basic and advanced economic techniques and their empirical applications in finance.	C4	ABCDEF
2	除了計量方法外，學生也可從課堂上學習到當前財務、經濟許多領域的重要研究課題，從中尋找自己有興趣之應用。	In addition to the econometric techniques, students will be able to be familiar with many important research topics in finance and economics. Among which, they can choose an interesting topic to apply and analyze.	C4	ABCDEF
3	學生將能夠自己尋找適當且重要的研究主題，並能夠利用上課所學之方法來分析，並能夠獨立完成一篇正式之學術文章。	Students will be able to find a proper and interesting research topic and conduct estimation and inference using the approaches discussed in the class.	C6	ABCDEF

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	學生可以了解各種基本的計量方法，並進一步學習較新且有用之實證模型與其在財務領域之應用。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	除了計量方法外，學生也可從課堂上學習到當前財務、經濟許多領域的重要研究課題，從中尋找自己有興趣之應用。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
3	學生將能夠自己尋找適當且重要的研究主題，並能夠利用上課所學之方法來分析，並能夠獨立完成一篇正式之學術文章。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論

本課程之設計與教學已融入下列本校基本素養與核心能力

淡江大學基本素養與核心能力	內涵說明
◆ 表達能力與人際溝通	有效運用中、外文進行表達，能發揮合作精神，與他人共同和諧生活、工作及相處。
◆ 科技應用與資訊處理	正確、安全、有效運用資訊科技，並能蒐集、分析、統整與運用資訊。
◆ 洞察未來與永續發展	能前瞻社會、科技、經濟、環境、政治等發展的未來，發展與實踐永續經營環境的規劃或行動。
◆ 學習文化與理解國際	具備因應多元化生活的文化素養，面對國際問題和機會，能有效適應和回應的全球意識與素養。
◆ 自我了解與主動學習	充分了解自我，管理自我的學習，積極發展自我多元的興趣和能力，培養終身學習的價值觀。
◆ 主動探索與問題解決	主動觀察和發掘、分析問題、蒐集資料，能運用所學不畏挫折，以有效解決問題。
◇ 團隊合作與公民實踐	具備同情心、正義感，積極關懷社會，參與民主運作，能規劃與組織活動，履行公民責任。
◆ 專業發展與職涯規劃	掌握職場變遷所需之專業基礎知能，管理個人職涯的職業倫理、心智、體能和性向。

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/09/05~ 100/09/11	Introduction	
2	100/09/12~ 100/09/18	Endogeneity Problems	
3	100/09/19~ 100/09/25	Instrumental Variables Approach	
4	100/09/26~ 100/10/02	Instrumental Variables Approach	
5	100/10/03~ 100/10/09	Generalized Method of Moments (GMM) Estimators	
6	100/10/10~ 100/10/16	Generalized Method of Moments (GMM) Estimators	
7	100/10/17~ 100/10/23	Panel Data Methods	
8	100/10/24~ 100/10/30	Dynamic Panel Data Models	
9	100/10/31~ 100/11/06	Midterm Report	
10	100/11/07~ 100/11/13	Difference-in-Differences Approach	
11	100/11/14~ 100/11/20	Difference-in-Differences Approach	
12	100/11/21~ 100/11/27	Propensity Score Matching Approaches	

13	100/11/28~ 100/12/04	Propensity Score Matching Approaches	
14	100/12/05~ 100/12/11	Propensity Score Matching Approaches	
15	100/12/12~ 100/12/18	Regression Discontinuity Design	
16	100/12/19~ 100/12/25	Regression Discontinuity Design	
17	100/12/26~ 101/01/01	Regression Discontinuity Design	
18	101/01/02~ 101/01/08	Final Report	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本		Roberts, M. R. and Whited, T. M. (2011), "Endogeneity in Empirical Corporate Finance", Working Paper.	
參考書籍			
批改作業 篇數		篇 (本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫)	
學期成績 計算方式		◆平時考成績：20.0 % ◆期中考成績：40.0 % ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。	