

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	應用計量經濟學	授課 教師	莊武仁 CHUANG WU-JEN
	APPLIED ECONOMETRICS		
開課系級	財金一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBBMM1A		
系 (所) 教育目標			
以完整進階的財務金融課程，培養具獨立分析、判斷與解決問題的財務專業人才。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 培養進階財務金融理論的知識。</p> <p>B. 提升應用理論與實務技巧。</p> <p>C. 加強邏輯推演的能力。</p> <p>D. 財金研究方法的學習與運用。</p> <p>E. 提升考取高階財金專業證照之能力。</p> <p>F. 具備學術未來深造的潛力。</p>			
課程簡介	本課程探討財務金融領域常用之計量模型和估計方法，如ARIMA、VAR、單根、共積模型、ARDL、ARCH、GMM和結構轉換模型等。		
	This course covers the essential and widely used models in the empirical analysis of financial economics, such as ARIMA, VAR, unit root, cointegration, ARDL, ARCH, GMM, and Regime switching models.		

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其「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	1. 應用計量經濟學之內含	1. 應用計量經濟學之內含 1. Contents of applied econometrics	C6	ABCDEF
2	2. 計量理論基礎	2. Theoretical basis of econometric models	C6	ABCDEF
3	3. 計量模型設定	3. Model specification	C6	ABCDEF
4	4. 估計方法	4. Estimation methods	C6	ABCDEF
5	5. 結構分析	5. Structural analysis	C6	ABCDEF
6	6. 計量模型運用	6. Application of econometric models	C6	ABCDEF

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	1. 應用計量經濟學之內含	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
2	2. 計量理論基礎	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
3	3. 計量模型設定	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
4	4. 估計方法	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
5	5. 結構分析	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
6	6. 計量模型運用	講述、討論、模擬、實作、問題解決	實作、報告、上課表現

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養與核心能力

淡江大學校級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	101/02/13~ 101/02/19	Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models	
2	101/02/20~ 101/02/26	Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models	
3	101/02/27~ 101/03/04	Vector Autoregression	
4	101/03/05~ 101/03/11	Unit Roots	
5	101/03/12~ 101/03/18	Unit Roots	
6	101/03/19~ 101/03/25	Cointegration and Error Correction Model	
7	101/03/26~ 101/04/01	Cointegration and Error Correction Model	
8	101/04/02~ 101/04/08	Cointegration and Error Correction Model	
9	101/04/09~ 101/04/15	Cointegration and Error Correction Model	
10	101/04/16~ 101/04/22	Generalized Method of Moments	
11	101/04/23~ 101/04/29	Generalized Method of Moments	
12	101/04/30~ 101/05/06	Generalized Method of Moments	

13	101/05/07~ 101/05/13	Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models	
14	101/05/14~ 101/05/20	Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models	
15	101/05/21~ 101/05/27	Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models	
16	101/05/28~ 101/06/03	Regime-switching models	
17	101/06/04~ 101/06/10	Regime-switching models	
18	101/06/11~ 101/06/17	Regime-switching models	
修課應 注意事項			
教學設備	電腦、投影機		
教材課本	Enders, W.: Applied Econometric Time Series Greene, W.H.: Econometric Analysis		
參考書籍	Kennedy, P.: A Guide to Econometrics Maddala, G.S.: Introduction to Econometrics		
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	◆出席率： 15.0 % ◆平時評量：15.0 % ◆期中評量： % ◆期末評量： % ◆其他〈報告〉：70.0 %		
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。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。		