

淡江大學 100 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	計量經濟學 (二)	授課 教師	劉德芝 LIU, DE-CHIH
	ECONOMETRICS (II)		
開課系級	產經一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBEXM1A		
系 (所) 教育目標			
培育具學術深造潛力的中級學術人才及產業分析的高級人才。			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 能具備產業經濟學相關領域之研究能力。</p> <p>B. 能具備理論推導與實務應用之能力。</p> <p>C. 能具備蒐集及整理相關研究文獻之能力。</p> <p>D. 能提升英語閱讀及以英語撰寫論文之能力。</p> <p>E. 能訓練學生尋找研究議題的能力。</p> <p>F. 能培養與論文指導教授合作撰寫論文之能力。</p> <p>G. 能具備繼續升學博士班之專業知識。</p> <p>H. 能培育具獨立高階實務分析及產業政策研究之能力。</p>			
課程簡介	課程目的為介紹時間序列相關計量模型，課程內容為第一章至第八章，另外，計量軟體EViews會同時介紹幫助同學去分析實證資料。		
	The aim of this course is to introduce the Time-Series Econometric models. The course includes Chapter 1 through 8. Moreover, EViews is introduced to solve the empirical exercises.		

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	了解時間序列之資料特性	Understanding the nature of Time-Series Econometric data	C2	CDF
2	介紹自我迴歸模型	Introducing the autoregression model	C2	CDG
3	自我迴歸暨移動平均模型之估計	To estimate the ARMA model	C2	CEG
4	結構性改變	Structural changes	C2	BCEG
5	ARCH/GARCH模型	ARCH/GARCH model	C2	BDEG
6	單根與隨機過程	Unit root and stochastic process	C2	ABEG
7	向量自我迴歸模型	Vector Autoregression model	C2	ABEG
8	共整合	Cointegration	C2	BCEH

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	了解時間序列之資料特性	講述、討論	紙筆測驗
2	介紹自我迴歸模型	講述、討論	紙筆測驗
3	自我迴歸暨移動平均模型之估計	講述、討論	紙筆測驗
4	結構性改變	講述、討論	紙筆測驗
5	ARCH/GARCH模型	講述、討論	紙筆測驗
6	單根與隨機過程	講述、討論	紙筆測驗
7	向量自我迴歸模型	講述、討論	紙筆測驗

8	共整合	講述、討論	紙筆測驗
---	-----	-------	------

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	時間序列之資料特性	
2	101/02/20~ 101/02/26	自我迴歸模型	
3	101/02/27~ 101/03/04	自我迴歸模型	
4	101/03/05~ 101/03/11	自我迴歸暨移動平均模型	
5	101/03/12~ 101/03/18	自我迴歸暨移動平均模型	
6	101/03/19~ 101/03/25	結構性改變	
7	101/03/26~ 101/04/01	結構性改變	
8	101/04/02~ 101/04/08	ARCH/GARCH模型	
9	101/04/09~ 101/04/15	ARCH/GARCH模型	
10	101/04/16~ 101/04/22	期中考試	
11	101/04/23~ 101/04/29	單根與隨機趨勢	
12	101/04/30~ 101/05/06	單根與隨機趨勢	

13	101/05/07~ 101/05/13	共整合	
14	101/05/14~ 101/05/20	共整合	
15	101/05/21~ 101/05/27	誤差修正模型	
16	101/05/28~ 101/06/03	誤差修正模型	
17	101/06/04~ 101/06/10	向量自我迴歸模型	
18	101/06/11~ 101/06/17	期末考試	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦	
教材課本		時間序列分析:經濟與財務上之應用;楊奕農,二版	
參考書籍		時間序列分析:總體經濟與財務金融之應用;陳旭昇,2rd edition Walter Enders, 2004. "Applied Econometric Time Series." 2nd edition, Wiley.	
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: 10.0 % ◆平時評量:10.0 % ◆期中評量:30.0 % ◆期末評量:30.0 % ◆其他〈報告〉:20.0 %	
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。	