

淡江大學 101 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 P	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TLBXMIP		
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. Contents of applied econometrics	C4	ABCDEF
2	2. 計量理論基礎	2. Theoretical basis of econometric models	C4	ABCDEF
3	3. 計量模型設定	3. Model specification	C4	ABCDEF
4	4. 估計方法	4. Estimation methods	C4	ABCDEF
5	5. 結構分析	5. Structural analysis	C4	ABCDEF
6	6. 計量模型運用	6. Application of econometric models	C4	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、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、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、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
4	4. 估計方法	講述、討論、實作、問題解決	實作、報告、上課表現
5	5. 結構分析	講述、討論、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、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

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◆ 全球視野	
◆ 洞悉未來	
◆ 資訊應用	
◆ 品德倫理	
◆ 獨立思考	
◆ 樂活健康	
◆ 團隊合作	
◇ 美學涵養	

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	102/02/18~ 102/02/24	A. Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models	
2	102/02/25~ 102/03/03	A. Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models	
3	102/03/04~ 102/03/10	A. Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models	
4	102/03/11~ 102/03/17	B. Vector Autoregression (VAR)	
5	102/03/18~ 102/03/24	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
6	102/03/25~ 102/03/31	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
7	102/04/01~ 102/04/07	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
8	102/04/08~ 102/04/14	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
9	102/04/15~ 102/04/21	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
10	102/04/22~ 102/04/28	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
11	102/04/29~ 102/05/05	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	

12	102/05/06~ 102/05/12	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM)	
13	102/05/13~ 102/05/19	D. Generalized Method of Moments (GMM) Estimator	
14	102/05/20~ 102/05/26	D. Generalized Method of Moments (GMM) Estimator	
15	102/05/27~ 102/06/02	E. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models (ARCH)	
16	102/06/03~ 102/06/09	E. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models (ARCH)	
17	102/06/10~ 102/06/16	F. Regime-switching models	
18	102/06/17~ 102/06/23	F. Regime-switching models	
修課應 注意事項	<p>依據本校學則第三十八條規定，曠課一小時，作缺課二小時論，學生所修習之科目缺課時數達全學期授課時數三分之一，該科學期成績以零分計算。</p> <p>※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。</p>		
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	<p>◆出席率： 30.0 % ◆平時評量： % ◆期中評量： %</p> <p>◆期末評量： %</p> <p>◆其他〈作業成績〉：70.0 %</p>		
備 考	<p>「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。</p> <p>※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。</p>		