

淡江大學 101 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	財務計量方法	授課 教師	王譯賢 YI-HSIEN WANG
	FINANCIAL ECONOMETRICS		
開課系級	管科一碩士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLGXM1A		
系（ 所 ） 教 育 目 標			
培育具備良好數理分析與邏輯判斷能力之中階管理人才，以因應國內外企業之需要。			
系（ 所 ） 核 心 能 力			
A. 培育具有決策分析課程學習之能力。 B. 培育具有企業經營課程學習之能力。 C. 培育具有統計分析課程學習之能力。 D. 培育具有財經分析課程學習之能力。 E. 培育具有科際整合之能力。 F. 培育具有企業實務之能力。 G. 具有外語運用能力。 H. 具有學術論文競賽能力。			
課程簡介	此課程可使學生了解財務計量方法，並可應用於經濟、商業、市場分析、財務金融及社會科學等領域。		
	From this course, students are required to understand the financial econometrics, which could apply to many fields, such as economics, commerce, market analysis, finance,social science.		

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	學生將能夠瞭解經財務計量方法分析的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下分析工具是有用的。	Students will be able to understand basic concepts and scope of financial econometrics and what circumstances are suitable for using these methods.	C2	ADFGH
2	學生將能夠對於較深入的學理及公式推導，進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	Students will be able to learn, derive and practice advanced formulas in order to get firm foundation in depth with advanced topics in future leaning career.	C4	ACDFGH
3	學生將能在瞭解經濟或財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用。	Students will be able to discover popular economic or financial issues, collect financial data, use the computer program to get analyzing results. They are also required to interpret or explain the empirical evidence.	C4	ACDFGH

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	學生將能夠瞭解經財務計量方法分析的基本概念與範圍，並瞭解在什麼情況下分析工具是有用的。	講述、討論	紙筆測驗、報告、上課表現
2	學生將能夠對於較深入的學理及公式推導，進行演練，以致於能增進未來更深入議題的扎實基礎。	講述、討論、課堂報告	紙筆測驗、報告

3	學生將能在瞭解經濟或財務研究議題的情況下，實際搜集資料並利用電腦統計軟體進行分析、解讀與應用。	講述、討論、實作	紙筆測驗、實作、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			
◆ 資訊運用			
◇ 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	課程規劃講解	
2	102/02/25~ 102/03/03	財務計量基本概念	
3	102/03/04~ 102/03/10	差分方程式概念	
4	102/03/11~ 102/03/17	差分方程式求解	
5	102/03/18~ 102/03/24	差分方程式特解求法	
6	102/03/25~ 102/03/31	落後操作	
7	102/04/01~ 102/04/07	隨機差分方程式	
8	102/04/08~ 102/04/14	定態觀念	
9	102/04/15~ 102/04/21	自我相關函數	
10	102/04/22~ 102/04/28	期中考試週	
11	102/04/29~ 102/05/05	偏自我相關函數	

12	102/05/06~ 102/05/12	ARMA模型之介紹	
13	102/05/13~ 102/05/19	ARMA模型之估計	
14	102/05/20~ 102/05/26	預測函數	
15	102/05/27~ 102/06/02	ARCH之過程與模型之估計	
16	102/06/03~ 102/06/09	GARCH模型之估計	
17	102/06/10~ 102/06/16	單根檢定	
18	102/06/17~ 102/06/23	期末考試週	
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, 2010, 3th Edition 楊奕農, 2009年, 時間序列分析：經濟與財務上之應用, 第二版, 雙葉書廊。	
參考書籍		陳旭昇, 2009年, 時間序列分析-總體經濟與財務金融之應用, 東華書局 Tsay, R. S. Analysis of Financial Time Series. 2005, Second Edition.	
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：20.0 % ◆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。	