

淡江大學 101 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	計量經濟理論 (二)	授課 教師	陳怡宜 CHEN YI-YI
	ECONOMETRICS (II)		
開課系級	經濟一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TLYXM1A		
系 ( 所 ) 教育目標			
<p>一、教授專業知識。</p> <p>二、訓練分析技能。</p> <p>三、建立判斷能力。</p> <p>四、展現人格特質。</p> <p>五、培養團隊精神。</p> <p>六、營造國際視野。</p>			
系 ( 所 ) 核心能力			
<p>A. 具備進階經濟理論的素養。</p> <p>B. 具備經濟應用的專業能力。</p> <p>C. 具備搜尋整理資料的能力。</p> <p>D. 具備展示研究成果的能力。</p> <p>E. 具備發掘與解決議題的能力。</p> <p>F. 具備剖析實際經濟問題的邏輯推演能力。</p> <p>G. 具備將經濟現象模型化的能力。</p> <p>H. 具備閱讀外文學術文章的能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程延續上學期教授的橫剖面資料之迴歸模型，探討模型中的假設條件不符合時，最小平方估計法是否能適用，如果不適用，是否有更好的估計方法。並將學習縱橫資料與時間序列資料的迴歸分析模型。</p>		
	<p>This course is the sequence of econometrics(I). The CLRM assumptions are always violated in real world. Thus, OLS estimators will be revised for any violations of assumptions. Also, we will learn the regression analysis of panel data and time series data.</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	讓學生瞭解實際的經濟資料並不完全符合古典迴歸模型的假設，面對這種狀況，如何估計才會更有效。	learning the MLR assumptions are not all satisfied in real world, the OLS estimators will be revised for some occasions	C3	BEGH
2	讓學生瞭解縱橫資料因涵蓋特別個體的訊息，迴歸估計方法不同於橫剖面資料。	understanding the panel data containing the characteristics of individual, there are two kind estimation methods: the fixed effect and the random effect.	C3	ABGH
3	讓學生瞭解時間序列資料通常具有相關性，迴歸分析方法不同於橫剖面資料。	understanding the time series data with autocorrelation and trend, we should be carefully dealing with the raw data before doing the regression analysis	C3	ABGH
4	讓學生學習計量軟體 (STATA)，能靈活運用上課所學習的模型。	learning how to use the econometric software(STATA) to analyze the examples in the textbook	C4	BH
5	讓學生能夠瞭解實證文章中所使用的估計方法。	understanding the estimation methods adopted in the empirical papers	C4	BH
6	讓學生未來在撰寫實證論文時，能夠知道選擇何種估計方法是恰當的。	knowing how to choose the suitable econometric model to analyze the collected data	C5	BH

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	讓學生瞭解實際的經濟資料並不完全符合古典迴歸模型的假設，面對這種狀況，如何估計才會更有效。	講述、討論	紙筆測驗、實作、上課表現

2	讓學生瞭解縱橫資料因涵蓋特別個體的訊息，迴歸估計方法不同於橫剖面資料。	講述、討論	紙筆測驗、實作、上課表現
3	讓學生瞭解時間序列資料通常具有相關性，迴歸分析方法不同於橫剖面資料。	講述、討論	紙筆測驗、實作、上課表現
4	讓學生學習計量軟體 (STATA)，能靈活運用上課所學習的模型。	討論、實作	紙筆測驗、實作
5	讓學生能夠瞭解實證文章中所使用的估計方法。	講述、討論	紙筆測驗、實作
6	讓學生未來在撰寫實證論文時，能夠知道選擇何種估計方法是恰當的。	講述、討論	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	Heteroskedasticity	
2	102/02/25~ 102/03/03	Misspecification/proxy variable/measurement error	
3	102/03/04~ 102/03/10	Measurement error/IV Estimation	
4	102/03/11~ 102/03/17	2SLS Estimation/Simutaneous Equations Models	
5	102/03/18~ 102/03/24	Limited Dependent Variables	
6	102/03/25~ 102/03/31	Tobit Model/ Censored and Truncated Regression/Sample Seclection	

7	102/04/01~ 102/04/07	Midterm Exam	
8	102/04/08~ 102/04/14	教學觀摩週	
9	102/04/15~ 102/04/21	Panel data (I)	
10	102/04/22~ 102/04/28	Panel data (II)	
11	102/04/29~ 102/05/05	Time Series -- Introduction	
12	102/05/06~ 102/05/12	ARMA model	
13	102/05/13~ 102/05/19	ARCH/GARCH model	
14	102/05/20~ 102/05/26	Dynamic model/ VAR	
15	102/05/27~ 102/06/02	Random Walk/Unit Root Test	
16	102/06/03~ 102/06/09	Cointegration	
17	102/06/10~ 102/06/16	Review	
18	102/06/17~ 102/06/23	Final Exam	
修課應 注意事項			
教學設備		(無)	
教材課本		Wooldridge (2009) "Introductory Econometrics: A Modern Approach," 4e. 楊奕農 (2009), "時間序列分析—經濟與財務上之應用", 雙葉書廊。	
參考書籍		Hsiao, C, "Analysis of Panel Data". Maddala, G.S., "Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics". Walter Enders (1995) "Applied Econometric Time Series", 雙業代理	
批改作業 篇數		10 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：30.0 %   ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量：30.0 % ◆其他〈 〉：        %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： <a href="http://info.ais.tku.edu.tw/csp">http://info.ais.tku.edu.tw/csp</a> 或由教務處 首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/">http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/</a> 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 <b>※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。</b>	