

淡江大學 103 學年度第 1 學期課程教學計畫表

|                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |          |                       |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|-----------------------|
| 課程名稱                                                                                                                              | 計量經濟學                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 授課<br>教師 | 黃河泉<br>HO-CHUAN HUANG |
|                                                                                                                                   | ECONOMETRICS                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |          |                       |
| 開課系級                                                                                                                              | 財金三 A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 開課<br>資料 | 必修 單學期 3學分            |
|                                                                                                                                   | TLBXB3A                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |          |                       |
| 系（ 所 ） 教 育 目 標                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |          |                       |
| 配合本校、院教育目標，因應國內外金融情勢的演變，培養財務金融理論與實務兼具的財務金融人才。                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |          |                       |
| 系（ 所 ） 核 心 能 力                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |          |                       |
| A. 具備財務金融理論與實務的基本知識。<br>B. 加強相關金融法規的學習。<br>C. 培養財務金融職場的基本倫理與道德。<br>D. 提升學生的國際觀與外語能力。<br>E. 提升學生專業證照之能力。<br>F. 具備分析國內外金融發展情勢之基本能力。 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |          |                       |
| 課程簡介                                                                                                                              | 本科目著重於結合其他財經科目之所學之理論與現實財經現象的關聯性。我們首先將會介紹各種型態的資料（橫斷面、時間序列與追蹤資料）。然後介紹線性迴歸（簡單迴歸與複迴歸）如何進行估計與相關之統計檢定，並應用於分析和驗證當前的財經相關課題。我們也會介紹虛擬變數的意義與應用並且也說明若迴歸遭遇到異質性變異數等問題時該如何解決。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |          |                       |
|                                                                                                                                   | This course focuses on the synthesis of financial (economic) theories and empirical applications. We first distinguish alternative data patterns (cross section, time-series and panel data). Then, we introduce the linear regression (simple or multiple) and show how to estimate parameters of interest as well as test relevant hypothesis. The meaning and application of dummy variable is also discussed. Finally, we further demonstrate how to deal with the problems of heteroskedasticity. |          |                       |

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  | 學生可以知道有哪些常用的財務資料、如何收集彙整與並了解其之特性。                | Students will be able to know and collect the commonly-used financial time series data and understand their respective properties.                                                                 | C4   | AF       |
| 2  | 學生將能夠學習並使用簡單與複迴歸模型，其中包括如何使用相關軟體與資料來從式估計(解釋)與檢定。 | Students will be able to implement simple and multiple regressions. Moreover, they are able to use software and data to estimate (and interpret) the regressions and test the relevant hypothesis. | C4   | AF       |
| 3  | 學生將能夠利用課堂所學的知識與技巧，針對當較簡單的金融市場相關問題作出實證上之分析與建議。   | Students will be able to employ the models and methods to empirically analyze some simple problems of financial markets.                                                                           | C6   | AF       |

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  | 學生可以知道有哪些常用的財務資料、如何收集彙整與並了解其之特性。                | 講述、討論、實作 | 紙筆測驗、實作、上課表現 |
| 2  | 學生將能夠學習並使用簡單與複迴歸模型，其中包括如何使用相關軟體與資料來從式估計(解釋)與檢定。 | 講述、討論、實作 | 紙筆測驗、實作、上課表現 |
| 3  | 學生將能夠利用課堂所學的知識與技巧，針對當較簡單的金融市場相關問題作出實證上之分析與建議。   | 講述、討論、實作 | 紙筆測驗、實作      |
|    |                                                 |          |              |

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     | 培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。           |
| ◆ 資訊運用     | 熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。             |
| ◆ 洞悉未來     | 瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。          |
| ◇ 品德倫理     | 了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。 |
| ◆ 獨立思考     | 鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。             |
| ◇ 樂活健康     | 注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。                 |
| ◆ 團隊合作     | 體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。    |
| ◇ 美學涵養     | 培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。              |

授 課 進 度 表

| 週次 | 日期起訖                    | 內 容 (Subject/Topics)   | 備 註         |
|----|-------------------------|------------------------|-------------|
| 1  | 103/09/15~<br>103/09/21 | 計量經濟學導論與 Stata 計量軟體之介紹 | Chapter 1   |
| 2  | 103/09/22~<br>103/09/28 | 簡線性單迴歸模型               | Chapter 2   |
| 3  | 103/09/29~<br>103/10/05 | 簡線性單迴歸模型/假設檢定          | Chapter 2/3 |
| 4  | 103/10/06~<br>103/10/12 | 假設檢定                   | Chapter 3   |
| 5  | 103/10/13~<br>103/10/19 | 配適度與模型建立               | Chapter 4   |
| 6  | 103/10/20~<br>103/10/26 | 複（多元）迴歸模型              | Chapter 5   |
| 7  | 103/10/27~<br>103/11/02 | 複（多元）迴歸模型              | Chapter 5   |
| 8  | 103/11/03~<br>103/11/09 | 複（多元）迴歸模型的進一步推論        | Chapter 6   |
| 9  | 103/11/10~<br>103/11/16 | 期中考（上機考試）              |             |
| 10 | 103/11/17~<br>103/11/23 | 期中考試週                  |             |
| 11 | 103/11/24~<br>103/11/30 | 非線性關係：多項式、虛擬變數         | Chapter 7   |
| 12 | 103/12/01~<br>103/12/07 | 非線性關係：虛擬變數             | Chapter 7   |

|              |                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |           |
|--------------|-------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|
| 13           | 103/12/08~<br>103/12/14 | 非線性關係：交互作用、對數--線性模型                                                                                                                                                                                                                                                             | Chapter 7 |
| 14           | 103/12/15~<br>103/12/21 | 異質性變異數：本質、OLS 與 Robust Standard Errors                                                                                                                                                                                                                                          | Chapter 8 |
| 15           | 103/12/22~<br>103/12/28 | 異質性變異數：Genealized (Weighted) LS                                                                                                                                                                                                                                                 | Chapter 8 |
| 16           | 103/12/29~<br>104/01/04 | 異質性變異數：檢定變異數                                                                                                                                                                                                                                                                    | Chapter 8 |
| 17           | 104/01/05~<br>104/01/11 | 期末考 (上機考試)                                                                                                                                                                                                                                                                      |           |
| 18           | 104/01/12~<br>104/01/18 | 期末考試週                                                                                                                                                                                                                                                                           |           |
| 修課應<br>注意事項  |                         | 1. 請準時出席、上課中請勿聊天。<br>2. 未出席者，每次扣學期成績3分(請假者減半)，遲到(上課10分鐘後)扣1分。<br>3. 上課答題加學期成績2分(上半與下半學期各最多4次)。<br>4. 由於電腦教室座位有限，本科目原則上"不予加簽"！                                                                                                                                                   |           |
| 教學設備         |                         | 電腦、投影機、其它(Stata 軟體)                                                                                                                                                                                                                                                             |           |
| 教材課本         |                         | 黃智聰、梁儀盈譯 (2013), "計量經濟學", 第3版, 雙葉書廊有限公司 (2368-4198 ext.15 or 鄧兆淇: 0936-098625)。                                                                                                                                                                                                 |           |
| 參考書籍         |                         | Hill, R. C., Griffiths, W. E. and Lim, G. C. (2012), "Principles of Econometrics." (4th Edition) 雙葉書廊有限公司 (2368-4198 ext.15 or 鄧兆淇: 0936-098625)。                                                                                                                               |           |
| 批改作業<br>篇數   |                         | 5 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<br>計算方式 |                         | ◆出席率： 25.0 %    ◆平時評量：        %    ◆期中評量：35.0 %<br>◆期末評量：40.0 %<br>◆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<br>首頁〈網址： <a href="http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php">http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php</a> 〉業務連結「教師教學<br>計畫表上傳下載」進入。<br><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> |           |