

## 高等計量經濟學 (產經博一) (週三, 6pm-9pm)

Fall 2006

### Course Outline:

1. Probit 與 Logit 模型
2. 應變數受限制的迴歸分析
3. 縱橫資料模型 (panel data models)
4. 最大概似估計法 (maximum likelihood estimation): 隨機邊界法 (stochastic frontier approach) 之應用
5. 無母數迴歸分析 (nonparametric regression analysis): 半母數迴歸分析
6. 定態時間數列分析 (stationary time series analysis)
7. 非定態時間數列分析 (non-stationary time series analysis)
8. The Generalized Regression Model
9. Systems of Regression Equations
10. Simultaneous Equation Models

### Grading:

1. Midterm 50%
2. Term Paper 50%

### Textbook:

1. 計量經濟學, 2005, 黃台心, 雙葉書廊, 台北。
2. Greene, W., 2003, *Econometric Analysis*, Prentice Hall, 第五版, 雙葉書廊代理, 台北。
3. Kumbhakar, S.C. and C.A.K. Lovell (2000), *Stochastic Frontier Analysis*, Cambridge University Press.

### References:

1. J. Johnston, and J. DiNardo, 1997, *Econometric Methods*, fourth edition, McGraw-Hill, 雙葉書廊代理, 台北。
2. J. Wooldridge, 2000, *Introductory Econometrics: A Modern Approach*, 新月圖書公司代理。
3. Matyas, L. (1999), *Generalized Method of Moments Estimation*, Cambridge University Press, Cambridge, U.K.