

淡江大學 96 學年度第 2 學期課程教學計劃表

科目名稱：應用計量經濟學

授課教師：莊武仁

開 課 班 級	財務金融學系碩士班		必 選 修	選 修
學 分 數	3學分 3小時 (上學期 3學分)		先 修 科 目	計量經濟學
教 學 內 容 及 進 度	週 次	月 / 日	內 容	
	1	2/18 ~ 2/24	開始上課 2/20	
	2 ~ 3	2/25 ~ 3/9	A. Autoregressive Integrated Moving Average (ARIMA) Models 1. Identification and Estimation 2. Diagnostic Checking 3. Forecasting	
	4	3/10 ~ 3/16	B. Vector Autoregression (VAR) 1. Impulse Response Function 2. Variance Decomposition 3. Structural VAR	
	5 ~ 12	3/17 ~ 5/11	C. Unit Roots, Cointegration and Error Correction Model (ECM) 1. Spurious Regression 2. Unit Roots Tests 3. Cointegration and ECM	
	13 ~ 14	5/12 ~ 5/25	D. Generalized Method of Moments (GMM) Estimator 1. Estimation 2. Testing	
	15 ~ 16	5/26 ~ 6/8	E. Autoregressive Conditional Heteroscedasticity Models (ARCH) 1. Estimation 2. Testing	
	17	6/9 ~ 6/15	F. Regime-switching models 1. Threshold Autoregressive TAR 2. Self-Exciting Threshold Autoregressive TAR (SETAR) 3. Smooth Transition AR (STAR) 4. Smooth Transition Error Correction Model (STECM)	
	18	6/16 ~ 6/22	期末考試週	

講授方式	<input checked="" type="checkbox"/> 課堂講授 <input checked="" type="checkbox"/> 報告討論 <input type="checkbox"/> 參觀實習 <input type="checkbox"/> 其他 (_____)		
教學設備	<input checked="" type="checkbox"/> 電腦 <input checked="" type="checkbox"/> 投影機 <input type="checkbox"/> 其他 (_____)		
教材課本	Enders, W.: <i>Applied Econometric Time Series</i> Greene, W.H.: <i>Econometric Analysis</i>		
參考書籍	Kennedy, P.: <i>A Guide to Econometrics</i> Maddala, G.S.: <i>Introduction to Econometrics</i>		
批改作業 篇數		備 註	本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫。
成績考核 方式	<input checked="" type="checkbox"/> 平時成績： 10 %	<input type="checkbox"/> 期中成績： %	<input type="checkbox"/> 期末成績： %
	<input checked="" type="checkbox"/> 報告： 4 次 90 %	<input type="checkbox"/> 其他 (_____)	: %
上課時間	星期二：2~4 (9:10~12:00, 教室 B915)		
約見時間	星期一：13:10~16:00 星期二：13:10~16:00 星期三：10:10~12:00 地點：B806 (淡水校園商管大樓八樓) 電話：2621-5656 分機 3335 E-mail: ewjch@mail.tku.edu.tw		
備考	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。		