

淡江大學 97 學年度第 2 學期課程教學計畫表(格式一)

授課科目名稱：財金資訊與實證

授課教師：鄭婉秀

開課班級	商學院共同科 (碩士班)				必/選修	選 修
學分數	3 學分 小時 (單學期 3 學分)		先修科目			
教學內容 及進度	週次	月/日	內 容			
	第一週	2/17	資料收集			
	第二週	2/24	時間序列導論 I			
	第三週	3/3	時間序列導論 II			
	第四週	3/10	定態時間序列 I			
	第五週	3/17	定態時間序列 II			
	第六週	3/24	單根與隨機趨勢			
	第七週	3/31	Break			
	第八週	4/7	預測表現之評估			
	第九週	4/14	結構性變動 I			
	第十週	4/21	Midterm			
	第十一週	4/28	結構性變動 II			
	第十二週	5/5	向量自我迴歸模型 I			
	第十三週	5/12	向量自我迴歸模型 II			
	第十四週	5/19	共整合與向量誤差修正模型 I			
	第十五週	5/26	共整合與向量誤差修正模型 II			
	第十六週	6/2	ARCH-GARCH 模型 I			
	第十七週	6/9	ARCH-GARCH 模型 II			
第十八週	6/16	Final				
講授方式	V	課堂講授	V	分組討論		參觀實習
						其他 (_____)
教學設備	V	電腦		投影機		其他 (_____)
教材課本	時間序列分析-總體經濟與財務金融之應用，初版，陳旭昇 著，2007。(東華)					
參考書籍	Introductory econometrics for finance, by Brooks, 2002. (東華)					
	Applied Econometric Time Series, 2 nd ed., by Enders, 2003. (雙葉)					
	財金計量，修訂版，鍾惠民 等著，2006。(雙葉)					
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教師填寫。		
成績考 核方式	V	平時成績： 10 %	V	平時報告： 90 %		期末考： %
		小考： %		其他 (_____):		%
備 考	本課程大綱得以因瞭解學生而隨時調整進度。					