

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等應用計量	授課 教師	黃河泉 Ho-chuan Huang
	ADVANCE APPLIED ECONOMETRICS		
開課系級	財金一博士班 A	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TBBMD1A		
學系(門)教育目標			
紮實的財務理論基礎與嚴謹的研究方法，培養具國際視野與獨立研究能力之學術人才。			
學生基本能力			
<p>A. 奠定紮實的財務金融理論基礎。</p> <p>B. 整合跨領域理論與實務的應用能力。</p> <p>C. 熟稔相關財金研究方法與成果。</p> <p>D. 具備獨立研究的學術能力。</p> <p>E. 培養金融環境的分析能力。</p> <p>F. 提升學生的教學素質。</p> <p>G. 提升學術研究國際化之能力。</p> <p>H. 強化學術研究團隊合作能力。</p>			
課程簡介	<p>本科目除了介紹一些於學術研究分析的基本方法外，並特別討論當前於實證分析中常用的進階模型與方法；同時，我們也會介紹一些相關的財金應用主題，讓學生能夠從中學習到如何找到適當研究題目、如何進行所需分析與如何撰寫並發表一篇正式論文。</p>		
	<p>This course first reviews some fundamental approaches for empirical research, and then proceeds to discuss more recent-advanced econometric techniques for finance. In particular, we will consider many empirical applications of those methods so that, during the course, students will be able to find some interesting topics, to conduct the empirical analysis and to write a decent academic paper for publication.</p>		

本課程教學目標與目標層級、學生基本能力相關性

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」、「學生基本能力」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該系「學生基本能力」。單項教學目標若對應「學生基本能力」有多項時，則可填列多項「學生基本能力」(例如：「學生基本能力」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	學生基本能力
1	學生可以了解各種基本的計量方法，並進一步學習較新且有用之實證模型與其在財務領域之應用。	Students will be able to learn a variety of basic and advanced economic techniques and their empirical applications in finance.	C4	ABCDEFGH
2	除了計量方法外，學生也可從課堂上學習到當前財務、經濟許多領域的重要研究課題，從中尋找自己有興趣之應用。	In addition to the econometric techniques, students will be able to be familiar with many important research topics in finance and economics. Among which, they can choose an interesting topic to apply and analyze.	C4	ABCDEFGH
3	學生將能夠自己尋找適當且重要的研究主題，並能夠利用上課所學之方法來分析，並能夠獨立完成一篇正式之學術文章。	Students will be able to find a proper and interesting research topic and conduct estimation and inference using the approaches discussed in the class.	C6	ABCDEFGH

教學目標之教學策略與評量方法

序號	教學目標	教學策略	評量方法
1	學生可以了解各種基本的計量方法，並進一步學習較新且有用之實證模型與其在財務領域之應用。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
2	除了計量方法外，學生也可從課堂上學習到當前財務、經濟許多領域的重要研究課題，從中尋找自己有興趣之應用。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論
3	學生將能夠自己尋找適當且重要的研究主題，並能夠利用上課所學之方法來分析，並能夠獨立完成一篇正式之學術文章。	課堂講授、分組討論	出席率、報告、討論

授 課 進 度 表

週次	日期	內 容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	Introduction	
2	09/20	OLS, IV and GMM	
3	09/27	Panel Data Model (FE and RE)	
4	10/04	Dynamic Panel Data Model (GMM)	
5	10/11	Unit Root Tests	
6	10/18	Panel Unit Root Tests (Conventional Approach)	
7	10/25	Panel Unit Root Tests (Structural Change)	
8	11/01	Panel Unit Root Tests (Cross-Sectional Dependence)	
9	11/08	Panel Unit Root Tests (Cross-Sectional Dependence)	
10	11/15	Midterm Report	
11	11/22	Panel Unit Root Tests (SC+CSD)	
12	11/29	Panel Unit Root Tests (SC+CSD)	
13	12/06	Mean Group and Pooled Mean Group Estimators (I)	
14	12/13	Mean Group and Pooled Mean Group Estimators (II)	
15	12/20	Threshold Panel Unit Root Tests	
16	12/27	Threshold Panel Data Model (I)	
17	01/03	Threshold Panel Data Model (II)	
18	01/10	Final Report	

修課應
注意事項

教學設備

電腦、投影機

教材課本

Journal papers.

參考書籍

--	--	--	--

批改作業 篇數	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	◆平時考成績：10.0 % ◆期中考成績：40.0 % ◆期末考成績：50.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈 〉： %
備 考	「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/index.asp/ 〉教務資訊「教學計畫 表管理系統」進入。 ※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。