

淡江大學 99 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	高等計量經濟學	授課 教師	胡登淵 Hu, Teng-yuan
	ADVANCED ECONOMETRICS		
開課系級	產經一博士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBEXD1A		
學系(門)教育目標			
培育具研究與教學能力的高級學術人才。			
學生基本能力			
<p>A. 能具備產業、經濟學相關領域之獨立研究能力。</p> <p>B. 能訓練學生獨立分析的能力。</p> <p>C. 能訓練學生閱讀相關文獻的能力。</p> <p>D. 能訓練學生尋找研究議題的能力。</p> <p>E. 能訓練學生理解文獻與報告的能力。</p> <p>F. 能幫助學生與其論文指導教授的溝通成效。</p> <p>G. 能訓練學生撰寫國際優良論文的能力。</p> <p>H. 能訓練學生將來成為一優秀的高級產業分析人才。</p> <p>I. 能訓練學生將來成為一優秀的學術研究人才。</p>			
課程簡介	本課程擬廣泛介紹當代計量經濟方法，教學對象是博士生一年級。		
	This course aims at providing the first-year Ph.D. student with a comprehensive coverage of modern econometric methods.		

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	能使用當代計量經濟方法	capable of using modern econometric methods	P3	ABCDEFGHI
2	估計	Estimation	P3	ABCEGHI
3	檢定	Testing	P3	ABCEGHI
4	推導漸近分配	Deriving asymptotic theory	P1	AGI

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	能使用當代計量經濟方法	課堂講授	報告、期中考、期末考
2	估計	課堂講授	報告、期中考、期末考
3	檢定	課堂講授	報告、期中考、期末考
4	推導漸近分配	課堂講授	期中考、期末考

授課進度表

週次	日期	內容 (Subject/Topics)	備註
1	09/13	Overview of econometric methods	
2	09/20	Tool I: Brownian motion and stochastic integral	
3	09/27	Tool II: Introduction to GAUSS	
4	10/04	Tool III: Asymptotic distribution theory	

5	10/11	Macroeconometrics: Introduction	
6	10/18	Asymptotic theory of unit root test (I)	
7	10/25	Asymptotic theory of unit root test (II)	
8	11/01	Structural change and threshold	
9	11/08	Unit root test with structural changes	
10	11/15	期中考	
11	11/22	Maximum Likelihood Estimation	
12	11/29	Microeconometrics: Introduction	
13	12/06	Topics on Microeconometrics	
14	12/13	GMM	
15	12/20	Quantile regression	
16	12/27	Nonparametrics/ Semiparametrics	
17	01/03	Panel data analysis	
18	01/10	期末考	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機、其它(胡登淵老師個人網頁(http://mail.tku.edu.tw/tyhu/))	
教材課本		Cameron, A.C. and P.K. Trivedi, Microeconometrics—Methods and Applications, Cambridge Univ. Press, 2005. Hamilton, J.D. Time Series Analysis, Princeton Univ. Press, 1994.	
參考書籍		Greene, W.H. Econometric Analysis, Prentice Hall, fifth ed., 2003, Hansen, B.E. Econometrics, 2009. Hsiao, Cheng. Analysis of Panel Data, Cambridge University Press, 2nd edition. Maddala, G. Limited Dependent and Qualitative Variables in Econometrics, Cambridge University Press, 1983. Wooldridge, J.M. Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data, MIT Press. Tsay, Ruey S. Analysis of Financial Time Series, 2nd edition,	
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：25.0 % ◆期末考成績：40.0 % ◆作業成績： % ◆其他〈報告〉：25.0 %	

備考	<p>「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。</p> <p>※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。</p>
----	---