

淡江大學 99 學年度第 2 學期課程教學計畫表

課程名稱	計量經濟理論 (二)	授課 教師	陳怡宜 Chen Yi-yi
	ECONOMETRICS (II)		
開課系級	經濟一碩士班 A	開課 資料	必修 單學期 3學分
	TBYMM1A		
學系(門)教育目標			
<p>一、教授專業知識。</p> <p>二、訓練分析技能。</p> <p>三、建立判斷能力。</p> <p>四、展現人格特質。</p> <p>五、培養團隊精神。</p> <p>六、營造國際視野。</p>			
學生基本能力			
<p>A. 具備進階經濟理論的素養。</p> <p>B. 具備經濟應用的專業能力。</p> <p>C. 具備搜尋整理資料的能力。</p> <p>D. 具備展示研究成果的能力。</p> <p>E. 具備發掘與解決議題的能力。</p> <p>F. 具備剖析實際經濟問題的邏輯推演能力。</p> <p>G. 具備將經濟現象模型化的能力。</p> <p>H. 具備閱讀外文學術文章的能力。</p>			
課程簡介	<p>本課程延續上學期教授的橫剖面資料之迴歸模型，探討模型中的假設條件不符合時，最小平方估計法是否能適用，如果不適用，是否有更好的估計方法。並將學習縱橫資料與時間序列資料的迴歸分析模型。</p>		
	<p>This course is the sequence of econometrics(I). The CLRM assumptions are always violated in real world. Thus, OLS estimators will be revised for any violations of assumptions. Also, we will learn the regression analysis of panel data and time series data.</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	讓學生瞭解實際的經濟資料並不完全符合古典迴歸模型的假設，面對這種狀況，如何估計才會更有效。	learning the MLR assumptions are not all satisfied in real world, the OLS estimators will be revised for some occasions	C4	ABFH
2	讓學生瞭解縱橫資料因涵蓋特別個體的訊息，迴歸估計方法不同於橫剖面資料。	understanding the panel data containing the characteristics of individual, there are two kind estimation methods: the fixed effect and the random effect.	C3	ABGH
3	讓學生瞭解時間序列資料通常具有相關性，迴歸分析方法不同於橫剖面資料。	understanding the time series data with autocorrelation and trend, we should be carefully dealing with the raw data before doing the regression analysis	C3	ABGH
4	讓學生學習計量軟體 (STATA)，能靈活運用上課所學習的模型。	learning how to use the econometric software (STATA) to analyze the examples in the textbook	C4	BF
5	讓學生能夠瞭解實證文章中所使用的估計方法。	understanding the estimation methods adopted in the empirical papers	C4	BH
6	讓學生未來在撰寫實證論文時，能夠知道選擇何種估計方法是恰當的。	knowing how to choose the suitable econometric model to analyze the collected data	C5	ABCFG

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	讓學生瞭解實際的經濟資料並不完全符合古典迴歸模型的假設，面對這種狀況，如何估計才會更有效。	課堂講授、隨機抽問	出席率、期中考、期末考、作業

2	讓學生瞭解縱橫資料因涵蓋特別個體的訊息，迴歸估計方法不同於橫剖面資料。	課堂講授、隨機抽問	出席率、期中考、期末考、作業
3	讓學生瞭解時間序列資料通常具有相關性，迴歸分析方法不同於橫剖面資料。	課堂講授、隨機抽問	出席率、期中考、期末考、作業
4	讓學生學習計量軟體 (STATA)，能靈活運用上課所學習的模型。	課堂講授	討論、作業
5	讓學生能夠瞭解實證文章中所使用的估計方法。	課堂講授、隨機抽問	討論
6	讓學生未來在撰寫實證論文時，能夠知道選擇何種估計方法是恰當的。	課堂講授、隨機抽問	期中考、期末考

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	100/02/14~ 100/02/20	Introduction / Heteroskedasticity	
2	100/02/21~ 100/02/27	More on specification	
3	100/02/28~ 100/03/06	和平紀念日	
4	100/03/07~ 100/03/13	Instrumental variables estimation and 2SLS	
5	100/03/14~ 100/03/20	Simultaneous equations models	
6	100/03/21~ 100/03/27	Limit dependent variable models (I)	
7	100/03/28~ 100/04/03	Limit dependent variable models (II)	
8	100/04/04~ 100/04/10	兒童節	
9	100/04/11~ 100/04/17	Simple panel data methods	
10	100/04/18~ 100/04/24	期中考試週	
11	100/04/25~ 100/05/01	Advanced panel data methods	
12	100/05/02~ 100/05/08	Basic regression analysis with time series data (I)	
13	100/05/09~ 100/05/15	Basic regression analysis with time series data (II)	
14	100/05/16~ 100/05/22	Correlation and Heteroskedasticity in time series regressions	
15	100/05/23~ 100/05/29	ARCH and GARCH model, VAR	
16	100/05/30~ 100/06/05	Cointegration	
17	100/06/06~ 100/06/12	review	

18	100/06/13~ 100/06/19	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備	(無)		
教材課本	Wooldridge (2009) "Introductory Econometrics: A Modern Approach," 4e. 楊奕農 (2009), "時間序列分析—經濟與財務上之應用", 雙葉書廊。		
參考書籍	Hsiao, C, "Analysis of Panel Data". Maddala, G.S., "Limited-Dependent and Qualitative Variables in Econometrics". Hamilton, J.D., "Time Series Analysis". Walter Enders (1995) "Applied Econometric Time Series", 雙業代理。 陳旭昇 (2009), "時間序列分析", 東華書局。		
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：35.0 % ◆期末考成績：35.0 % ◆作業成績： 20.0 % ◆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。		