

朝陽科技大學
101學年度第2學期教學大綱

當期課號	7014	中文科名	計量經濟學
授課教師	李見發	開課單位	財務金融系
學分數	3	修課時數	3
修習別	專業必修	開課班級	日間部碩士班1年級 A班
類別	英語授課		

本課程與系所培養學生核心能力關聯度	高度 關聯	中高 關聯	中度 關聯	中低 關聯	低度 關聯
財金理論與實務專業之能力。	✓				
研究分析與規劃執行之能力。	✓				
倫理道德與社會責任之能力。					✓
國際視野與外國語言之能力。				✓	

本課程培養學生下列知識：

本課程討論迴歸之係數估計與檢定，以及假設條件不成立之問題及解決之道，模型之設定及選擇之問題，接著介紹時間數列分析與新近計量經濟分析方法之進展。期許修習之後有能力解讀一般之實證分析及獨立做一些實證研究。

1. 認識討論簡單迴歸及多元迴歸之係數估計與各種假設條件不成立之問題及解決之道
2. 瞭解模型之設定及選擇之問題
3. 探討質變數的迴歸分析
4. 認識時間數列分析與新近計量經濟分析方法之進展
5. 瞭解縱橫資料分析

Reviews regression and time series analysis, covered in the course of Quantitative Methods, and introduces the recent developments in Econometrics and Time Series Analysis with emphasis on their applications to financial researches.

每週授課主題

- 第01週：Some Basic Probability Concepts
- 第02週：The Simple Linear Regression Model
- 第03週：Multiple Regression Analysis- Estimation
- 第04週：Multiple Regression Analysis-Inference
- 第05週：Further Issues with classical linear regression mo
- 第06週：Regression Analysis with Qualitative Information
- 第07週：Unit root; Univariate Time Series Modeling: AR; MA
- 第08週：Midterm Examination
- 第09週：(1) Multivariate Model: Simultaneous Equations VAR
- 第10週：(2) Multivariate Model: Simultaneous Equations VAR
- 第11週：(1) Modeling long-run relationship in finance: Co
- 第12週：(2) Modeling long-run relationship in finance: Co
- 第13週：(3) Modeling long-run relationship in finance: Co
- 第14週：(1) Modeling Volatility and Correlation: ARCH; GAR
- 第15週：(2) Modeling Volatility and Correlation: ARCH; GAR
- 第16週：(3) Modeling Volatility and Correlation: ARCH; GAR
- 第17週：(4) Modeling Volatility and Correlation: ARCH; GAR
- 第18週：Final Examination

成績及評量方式

- 期中考：30%
- 學習態度：15%
- 平時作業及出席：15%
- 期末考：40%

證照、國家考試及競賽關係

本課程無證照、國家考試及競賽資料。

主要教材

- 1. Chris Brooks, Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University, Second edition.. (教科書)

參考資料

書名：Introductory Econometrics for Finance, 作者：Chris Brooks 出版年(西元)：2002 出版社：Cambridge University

建議先修課程

本課程無建議先修課程

教師資料

教師網頁：<http://www.cyut.edu.tw/~jfli/>

E-Mail：jfli@cyut.edu.tw

Office Hour：

星期三,第3~4節,地點:T2-1026;

星期五,第1~2節,地點:T2-1026;

分機:4283

[\[關閉\]](#) [\[列印\]](#)

尊重智慧財產權，請勿不法影印。