

**朝陽科技大學**  
**105學年度第1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	一般課程		

**本課程與系所培養學生能力指標關聯度：**

核心能力	能力指標	關聯度		
		高度關聯	中度關聯	低度關聯
財金理論與實務專業之能力。	財報分析及企業評價。			✓
研究分析與規劃執行之能力。	分析、研究各類型金融商品之市場資訊及未來趨勢，隨時掌握投資市場的脈動。		✓	
倫理道德與社會責任之能力。	描述公司治理與企業財務的關係。		✓	
國際視野與外國語言之能力。	撰寫中英文書面報告及進行口頭簡報。	✓		

**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：統計概念複習
- 第02週：簡單迴歸
- 第03週：(1)多元迴歸模型
- 第04週：(2)多元迴歸模型
- 第05週：迴歸模型的一些課題
- 第06週：質性模型模型
- 第07週：自我相關模型(AR; MA)
- 第08週：期中考
- 第09週：(1)多變量模型(VAR)
- 第10週：(2)多變量模型(VAR)
- 第11週：(1)共積關係
- 第12週：(2)共積關係
- 第13週：(3)共積關係
- 第14週：(1)ARCH & GARCH
- 第15週：(2)ARCH & GARCH
- 第16週：(3)ARCH & GARCH
- 第17週：(4)ARCH & GARCH
- 第18週：期末考

**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

本課程無參考資料!

#### 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](mailto:jfli@cyut.edu.tw)

Office Hour：

星期一,第5~6節,地點:T2-1026;

星期四,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。