

朝陽科技大學  
112學年度第1學期教學大綱

當期課號	7012	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
		開課班級	日間部碩士班1年級 A班
修習別	專業必修		
類別	一般課程		

**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：(1)多變量模型(VAR)
- 第09週：期中考
- 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：期末考
- 第18週：(4) ARCH & GARCH

**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：

星期二,第2~3節,地點:T2-1026;

星期三,第5~6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。