



《尊重智慧財產權，請使用正版教科書，勿非法影印書籍及教材，以免侵犯他人著作權》

開課班級：四財金學士學程三A

授課老師：呂素蓮

學分數：3

課程大綱：

本課程之目的，在於介紹財務所使用的財金計量模型及工具。本課程將提供學生如何應用實際的財務資料，建構適當的模型，以及進行模型估計與檢定，主要內容包括：1.異質變異。2.相關性分析。4.診斷性檢定。5.時間序列模型。6.單根檢定。7.GARCH模型。

outline:

The purpose of this course focused upon models of processes that occur in finance. Quantitative tools that are used to construct and then test mathematical representations of the real world would be introduced. With the training of this course, the students would gain some understanding of the science and art of determining what type of model to be build, building the model which is most appropriate, testing the model statistically, and then finally applying the model to practical problems in analysis. The major contents of this course include: 1.Heteroscedasticity; 2.correlation test;3.Diagnostic test; 4.Time series model;5.Unit roots test;6.GARCH model.

教學型態：

其他

成績考核方式：

平時成績:30%

期中考:%

期末考:40%

其它:出缺勤，課堂表現30%
%

本科目教學目標：

本課程著重學生計量經濟分析能力的培養，透過計量方法與模型的學習，培養學生針對財金或經濟問題能採用適當的計量方法與模型，能夠將金融市場的資料轉換成有用的資訊，利用計量軟體分析財金或經濟資料，並且能夠正確且有效地分析實證結果，提出有效率的解決方式。

參考書目：

Chris Brooks (2014), Introductory Econometrics for Finance, 3/e, Cambridge University, 東華書局/新月圖書



課程進度表：

週次	起訖月日	授課單元(內容)	備註
第1週	2.21~2.28	Introduction	8日正式上課。8~12日課程加退選，轉學(系)生、復學生及延修生選課，雙主修、輔系申請，12日申辦抵免學分截止日
第2週	2.28~3.07	Review of linear regression model	
第3週	3.07~3.14	The assumptions of linear regression model-1	28日(日)孔子誕辰紀念日/教師節(放假),29日(一)補假
第4週	3.14~3.21	The assumptions of linear regression model-2	29日成績優異提前畢業者提出申請截止日
第5週	3.21~3.28	Diagnostic tests-1	6日(一)中秋節(放假)，10日(五)國慶日(放假)
第6週	3.28~4.04	Diagnostic tests-2	14日學生宿舍安全輔導暨複合式防災疏散演練。18日多益測驗
第7週	4.04~4.11	Dummy variable	24日(五)補假，25日(六)光復暨古寧頭大捷日(放假)。
第8週	4.11~4.18	Structural break test-1	30日校課程委員會
第9週	4.18~4.25	Structural break test-2	3~9日期中考試
第10週	4.25~5.02	Time series model-1	13日教務會議,16日教師期中成績上網登錄截止日
第11週	5.02~5.09	Time series model-2	
第12週	5.09~5.16	Simultaneous equations systems-1	24~28體育運動週。24日校園路跑。27日運動大會夜間開幕，28日運動大會活動，29日101週年校慶活動日，照常上班
第13週	5.16~5.23	Simultaneous equations systems-2	
第14週	5.23~5.30	Unit root test	12日申請停修課程截止日
第15週	5.30~6.06	Cointegration	
第16週	6.06~6.13	Panel data model-1	22日校務會議。25日行憲紀念日(放假)
第17週	6.13~6.20	Panel data model-2	1日(四)開國紀念日(放假)
第18週	6.20~6.27	Final exam	5~11日期末考試，10~11日學生退宿