

課程綱要與教學進度

106 學年度第 2 學期

課程名稱：（中文）計量經濟學(博)		開課單位	經營管理研究所				
（英文）Econometrics		永久課號	IBM6013				
授課教師：胡均立							
學分數	3	必/選修	選修		開課年級	博、碩士班	
先修科目或先備能力： 統計學							
課程概述與目標：							
<ol style="list-style-type: none"> 1. 介紹計量經濟學方法、技巧與應用。 2. 強調動手執行估計與檢定的能力。 3. 著重於進階議題上，例如：統計檢定、聯立方程式、時間序列、縱橫面資料等，以提供學生撰寫論文時之必要計量經濟學分析工具。 4. 著重於管理學門議題之應用，例如：財金計量、產業經濟學、國際企業研究等。 5. 本學期將以 Eviews 為主要教學軟體。 							
教科書(請註明書名、作者、出版社、出版年等資訊)	Hill, R.C., W.E. Griffiths, G.C. Lim (2008), Principles of Econometrics, 3rd ed., John Wiley & Sons. 雙葉代理。						
課程大綱			分配時數				備註
單元主題	內容綱要	講授	示範	習作	其他 ¹		
	1. 2. 3. 4.						
教學要點概述							
1 學期作業							
2.考試狀況							
3.評量方法 出席率（25%）、平時習作（25%）、期中計畫書（10%）、期末口頭報告（20%）、書面報告（20%）							
4.教學方法及教學相關配合事項(如網站、助教、圖書講義及資料庫等) 課程進行採老師按教材授課、學生抄寫筆記、閱讀課本、書面及電腦習作、師生交叉發問等方式進行。							
E-mail: jinlihu@mail.nctu.edu.tw							
個人網頁: http://jinlihu.netfirms.com							

師生晤談 (Office Hours)	排定時間	地 點	連絡方式
	星期二 PM 3:30~5:00	D11	E-mail

教學進度表

週次	上課日期	課程進度、內容、主題
1		Introduction of econometrics
2		The basic linear regression model
3		Classic assumptions, BLUE
4		Wald test, Chow test
5		Heterogeneity: White's test
6		Estimation of simultaneous-equations Systems: 2SLS
7		Regression topics: Maximum likelihood, Tobit, Logit, Probit, Truncated regression
8		Midterm Proposal
9		Time series analysis: Stationarity, Unit root tests
10		Time series analysis: AR1
11		Time series: Box-Jenkins Procedure
12		Time series: ARMA, ARIMA
13		Time series: Granger Causality, VAR
14		Time Series: Cointegration, VECM
15		Time Series: ARCH, GARCH
16		Estimation of panel data: Fixed-effects model, Random-effects model, Hausman test
17		Seemingly unrelated regression (SUR), Quantile regression
18		Final Term Paper Presentation

備註：

1. 其他欄包含參訪、專題演講等活動。
2. 請同學遵守智慧財產權觀念及勿使用非法影印教科書。