

| | | | |
|---------------|---|--------|-----------------------|
| 課程名稱 (中英文) | 應用計量分析中國財政研究 | | |
| | Applied Econometrics for Topics in China's Fiscal Policy | | |
| 授課教師 | 黃智聰 | 開課單位 | 政治大學財政所與東亞所 |
| 專兼任職稱 | 財政系專任教授 | 開課學年學期 | 99 學年度第 2 學期 |
| 修別 | 選修 | 學分數 | 3 學分 |
| 先修科目 | 無 | 人數限制 | 25 人 |
| 上課時間 | 星期一 (14:10~17:00) | 上課地點 | 政大社科院電腦教室 綜合院館南棟六樓 |
| 課程目標 | <p>本課程主要是提供財政所與東亞所與想要從事大陸經濟相關研究的研究生，在不熟悉以電腦估計模型之背景下，充分瞭解每一個計量模型之緣起、其中蘊含之意義、應用、與熟練之電腦操作技巧，並在其從事經濟、政治、社會與其他相關領域之實証研究時，能夠充分掌握計量模型之正確運用。有鑑於大多數的同學對計量分析的涉略不深，因此本課程的設計主要將以觀念之解說為主，盡量減少以數學的方式說明。並且，配合各計量模型的多樣化相關應用文獻，包括中國財政、經濟，以及其他學門（含政治、社會問題、大陸問題、台灣問題等），來說明各模型之應用方向。此外，本課程特別重視計量軟體之操作技巧與模型估計之解釋。因此，上課地點選在電腦教室，讓同學一邊上課，也同時能有機會同時操作電腦。相信修習本課程後，同學在從事中國財政研究，以及其他相關經濟議題之研究時，在研究方法的選擇上，能有更多的選擇。並且，對於想以計量分析做為研究方法的同學而言，這門課程是相當重要且實用的。</p> | | |
| 課程大綱 | <p>計量模型主要是以統計學為基礎，所發展出來的一種因果關係的研究方法。更具體的說，就是在控制其他因素的情形下，研究一變數對另一變數之影響，或變數之間如何相互影響的方法。計量模型會因分析資料的型態與特質或研究的課題之不同有所差異。例如，橫斷面資料、追蹤資料、截斷資料、質量資料、期間資料、時間序列資料等等之資料型態；與連續變數、選擇變數、間斷變數等等之資料特質。因此，本課程之授課內容將先講解統計學的基本概念，再粗淺介紹不同類型資料，所應採用的各種基礎計量模型。有關課程大綱的內容，請參照下表之上課進度。</p> | | |

| | 日期 | 課程內容 |
|------|--|---------------------------------------|
| 上課進度 | 2/21 | 課程簡介 |
| | 2/28 | 228 紀念日放假 |
| | 3/7 | 資料的整理與表現 |
| | 3/14 | 抽樣與抽樣分配 |
| | 3/21 | 統計估計 |
| | 3/28 | 假設檢定 |
| | 4/4 | 變異數分析與卡方檢定 |
| | 4/11 | 計量經濟學導論、基礎機率概念 與簡單線性迴歸模型：設定與估計 |
| | 4/18 | 期中考 |
| | 4/25 | 最小平方估計式的性質、簡單迴歸模型之推論 |
| | 5/2 | 簡單線性迴歸模型：報告結果與選擇函數型式 |
| | 5/9 | 簡單線性迴歸模型：虛擬變數 |
| | 5/16 | 簡單線性迴歸模型：非線性模型、異質變異、自我相關 |
| | 5/23 | 簡單線性迴歸模型：隨機解釋變數與時間落差分配模型 |
| | 5/30 | 質化及有限的因變數模型 |
| | 6/6 | 時間序列與橫斷面資料的共用 |
| | 6/13 | 單根、共整合、VAR、VECM、以及 ARDL+Cointegration |
| | 6/20 | 期末考 |
| | | Frontier 技術效率模型 |
| 教學方式 | <p>約兩小時課程講解。在各模型介紹時，將選擇各研究領域相關應用之文獻加以輔助說明。如此，將可以加深同學對模型之瞭解，並提高同學在應用各計量模型之精確度。</p> <p>約半小時電腦操作。由老師教導同學如何操作電腦軟體，估計相關之計量模型，並解說如何解釋估計結果。務必讓所有的同學完全瞭解估計的電腦操作。此外，老師也將檢討並回答前一週每一位同學作業之相關問題。（將提供上課時電腦教學每一步驟之圖片說明，以方便同學瞭解與下課後之複習與練習）。</p> | |

| | |
|--|--|
| <p>課 評 程 分 要 標 求 準</p> | <p>每週之作業習題：10%。期中與期末考：80%（各 40%）。 全勤得 10%。</p> <p>作業：6~7 次。依當週所教授之課程內容，由教師提供所要分析的資料加以分析估計。（作業的每一題皆附有圖片解說，以方便同學在作業練習時，能有詳盡的參考依據。另外，根據過去的經驗，建議同學組成讀書小組。在作業的練習時，能聚在一起討論。除了讓學習的成效加強外，更能增加同學間與師生間的互動。）</p> <p>考試：期中考以統計為主，期末考以計量方法為主。期中與期末考皆以實際電腦操作估計為主，沒有數學的運算推導。期中與期末考主要的目的是在檢測每一位同學在獲得資料後，是否有以電腦估計的能力。因此期中與期末考的 80%（也就是學期總成績的 65%）來自於歷次作業的例題。若是認真的練習作業中的例題，並且不曾缺席，則同學的期末成績應在 85 分以上。</p> |
| <p>參 考 書 目</p> | <p>主要參考書：</p> <p>林惠玲、陳正倉（2002），《應用統計學》（第二版）。台北：雙葉書廊有限公司。</p> <p>Hill, C. R., W. E. Griffiths, and G. G. Judge, (2001), <i>Undergraduate Econometrics</i>. New York: John Wiley & Sons.（強烈建議用原文書）</p> <p>蔡建樹譯（2002），Hill, C. R., W. E. Griffiths, and G. G. Judge, (2001)，《初級計量經濟學》（第二版）。臺北市：臺灣西書。（這本書翻譯得不好）</p> <p>網站上資料</p> <p>http://www3.nccu.edu.tw/~jthuang/econometrics.html</p> <p>其他參考書：</p> <p>《中國統計年鑑》（各年）</p> <p>Limdep 7.0 User Guide.</p> <p>Eviews Sofeware User Guide.</p> |