|  |
| --- |
| 課程中文名稱 Title of Course in Chinese：**計量經濟**課程英文名稱 Title of Course in English：**Econometrics**應修系級 Major：**都市計劃研究所碩士班1  ,都市計劃研究所博士班1  ,都市計劃研究所博士班2  ,都市計劃研究所碩士班2  ,**授課教師 Instructor：**王千岳**選修類別 Required/Elective：**選**全半學年 Whole or Half of the Academic Year：**半**學年學　　分 Credit(s)：**2** 學分時　　數 Hour(s)：**2** 小時 |
| 教學目標 Course Objectives： What is Econometrics?"Econometrics is the study of the application of statistical methods to the analysis of economic phenomena" (Tintner,1953)"nowadays my definition would be that Econometrics is what econometrician do" (Goldberger, 1989)In the first issue of Econometrica, one of the best journals in Econometrics, the Econometric Society stated that its main object shall be to promote studies that aim at a unification of the theoretical-quantitative and the empirical-quantitative approach to economic problems and that are presented by constructive and rigorous thinking similar to that which has come to dominate the natural sciences. |
| 內容綱要/Course Outline： The course will be taught on the basis of Econometric Analysis (Greene, 1999, 2011).1. Introduction2. Matrix Algebra3. Probability and Distribution Theory4. Statistical Inference5. The Classical Multiple Linear Regression Model: Specification and Estimation6. Nonspherical Disturbances(Feasible Generalised Least Squares)7. Heteroscedasticity8. Instrumental Variable Estimation and Measurement Error9. Alternative Estimators for the Classical Regression Model: focusing on the Maximum Likelihood Estimator |
| 指定用書(Required Texts)： 1.Econometric Analysis (7th Edition) 2011，W. Greene。 |
| 其他參考資料(Other References)： Estimation and Inference in Econometrics, Davidson and Mackinnon, 1993A Guide to Econometrics, Fifth Edition, P. Kennedy, 2003Linear Algebra and Its Applications, 4th Edition, D. Lay, 2011 |