

【2013 年經濟計量實證研習營】

日期: 2013 年 9 月 5 日 (週四) 至 9 月 6 日 (週五)

地點: 國立臺灣大學管理學院 (教室另行通知)

主辦單位: 臺灣經濟計量學會 (<http://www.tesociety.org.tw/main.php>)

1. 課程規劃

- 財務實證研究之理論與實作-GARCH 與 Regime-Switching 模型 (程式範例: Eviews)

課程日期: 9 月 5 日 (週四)

課程講師: 王耀輝教授主講

- 總體經濟實證研究經驗分享-以貨幣政策與匯率政策研究為例 (程式範例: Eviews)

課程日期: 9 月 6 日 (週五)

課程講師: 陳旭昇教授主講

本課程每日上課六小時 (9:00-12:00、14:00-17:00) 且由主辦單位提供午餐 (12:00-14:00)，課程結束後會寄發學習證書給參加課程的學員。

2. 報名網址:

[我要參加 2013 年經濟計量實證研習營](#)

3. 收費方式:

- 8 月 19 日前報名，單日: 新台幣 2,500 元、雙日: 新台幣 4,800 元。
- 8 月 19 日後報名，單日: 新台幣 3,000 元、雙日: 新台幣 5,800 元。

請於上課當日 8:30-9:00 報到，並依所選課程於報到時繳費，憑識別證上課。

4. 開課門檻:

本研習營需於兩日課程之平均報名人數達 10 人以上才開課。主辦單位將於 8 月 21 日以電子郵件通知已報名者，是否開課與相關細節。

5. 電腦軟體:

請自備筆記型電腦。本研習營將使用由吳青公司 (www.sciformosa.com.tw) 所提供之 Eviews 試用版講解部分之程式範例；軟體將於課程中發放。

6. 師資簡介:

- 王耀輝教授 (國立臺灣大學財務金融學系教授)

個人網頁連結：<http://www.fin.ntu.edu.tw/~yhwang/>

曾發表之期刊：*Journal of Banking & Finance*, *Journal of Derivatives*, *Journal of Financial Markets*, *Journal of Futures Markets*

其它：期貨與選擇權學刊 編輯 (associate editor；2012 迄今)

- 陳旭昇教授 (國立臺灣大學經濟學系教授)

個人網頁連結：<http://homepage.ntu.edu.tw/~sschen/>

曾發表之期刊：*Journal of Banking & Finance*, *Journal of Development Economics*, *Journal of Empirical Finance*, *Journal of Money, Credit, and Banking*,
Oxford Bulletin of Economics and Statistics

7. 課程簡介

- 9 月 5 日之課程:

GARCH 與 Regime-Switching 模型為財務實證研究上的兩大重要模型，本課程將從 GARCH 與 Regime-Switching 模型的基礎架構開始，介紹模型的建構、估計與檢定方法，並講授其在財務領域的應用範例。此外，亦將介紹如何利用 EViews 進行實際的模型操作。整體課程設計以實用為目的，並提供相關範例，目的在使學員們能立即將此課程教授的方法應用於相關研究中。課程的內容（暫訂）包括：

- (1) GARCH 模型的建構、估計與檢定；
- (2) Regime-Switching 模型的建構、估計與檢定；
- (3) 財務議題應用實例；
- (4) EViews 軟體之基本介紹；
- (5) EViews 軟體之實例操作。

● 9月6日之課程:

陳教授將在此課程中，分享總體經濟實證研究的個人經驗。以貨幣與匯率政策為例，分享以下心得：

- (1) 如何尋找研究主題；
- (2) 如何選取與應用適當的經濟計量模型；
- (3) 貨幣政策與匯率政策研究常用經濟計量模型之介紹: 向量自我迴歸模型；
- (4) EViews 操作介紹。

本課程不著重經濟計量模型之詳細介紹，我們的重點將放在與各位學員分享，如何由選定研究主題開始，執行一個有趣且有意義的總體經濟實證研究計畫，實作上，將以 EViews 示範向量自我迴歸模型 (VAR) 之應用。如果時間允許，我們將進一步分享如何能在理想的期刊發表研究成果之相關經驗。

2013 年經濟計量實證研習營之相關訊息，請隨時查閱本會網站。如有疑問，請洽臺灣經濟計量學會張慈恬小姐 <電話：(02) 3366-9873，電子郵件：tes@gate.sinica.edu.tw>。