

课 程 大 纲

课程编号: 02812460	授课对象: 2012 级硕士
课程名称: 金融计量经济学 I	英文名称: Financial Econometrics
周学时/总学时: 3/54	学 分: 3
任课教师: 王志诚	开课学期: 2012 年秋
先修课程: 概率统计	

任课教师联系方式: 办公电话: 62759706。Email: zcwang@gsm.pku.edu.cn
辅导、答疑时间: 周四: 15: 00-16: 30

一、 项目培养目标

学习目标 1 教授学生最新的金融学、经济学和管理学的理论知识, 培养学生综合运用理论知识和解决实际金融问题的能力。

具体目标 1 系统掌握金融学、经济学和管理学的理论知识

具体目标 2 掌握数量化与分析问题的能力

具体目标 3 能够综合应用所学的理论知识和方法解决实际问题

学习目标 2 培养学生良好的沟通能力, 使之适应在各类金融机构和企业的工作。

具体目标 1 具备良好的口头交流

具体目标 2 具备良好的书面交流能力

具体目标 3 具备良好的团队合作精神

学习目标 3 具有良好的社会责任感和伦理道德观

学习目标 4 具有国际化的视野

具体目标 1 理解金融的商业环境存在文化差异

具体目标 2 了解全球不同的金融体系

具体目标 3 适应在跨国金融机构有效工作。

二、 课程概述

本课程为金融学专业硕士生的选修课程。本课程的主要目的是为本科没有学习过《计量经济学》的同学介绍计量经济学基础和金融时间序列模型的基础, 为继续学习《金融计量经济学 II》打下基础。为了对方法使用和理解的方便, 按照横截面、时间序列和面板(panel data)数据类型分别介绍基本的建模和推断方法。首先介绍基本的多元回归模型在金融领域的应用方法。随后根据金融市场中具有大量的时间序列数据这一特征, 引入相关的金融时间序列分析方法。主要讨论平稳时间序列的基本模型--ARMA 模型; 从利用时间数据建模的步骤, 模型参数的估计方法和通过模型进行预测及相关推断方法三个方面进行介绍。根据大量金融数

据呈现面板数据的特征，最后一章介绍面板数据分析方法。

三、课程目标（包括学生所提高的技能要求），本课程目标如何服务于项目的培养目标

本课程的主要目的是介绍如何利用金融数据建立计量模型和对相关的金融理论和金融变量之间的关系进行实证研究的方法。

在课程结束时，学生应该能够：

1. 理解使用回归模型需要注意的假设条件，根据实际数据的情况正确使用模型；
2. 能够根据现实数据条件选择合适的回归模型处理方式；
3. 掌握时间序列数据建模的基本方法，对给定的一个时间序列数据，能选定一个适合的模型，并能诊断模型的适应性；
4. 能使用横截面回归分析方法处理金融数据；

四、内容提要及学时分配

	日期	内容
1	9月13日	序言
2	9月20日	第一章：线性回归模型的基本概念
3	9月27日	第一章：线性回归模型的基本概念
4	10月4日	国庆节停课
5	10月11日	第二章：线性回归模型的应用
6	10月18日	第二章：线性回归模型的应用
7	10月25日	第三章：异常情况下的多元回归分析
8	11月1日	第三章：异常情况下的多元回归分析
9	11月8日	第三章：异常情况下的多元回归分析
10	11月15日	第四章：时间序列分析基础
11	11月22日	第四章：时间序列分析基础
12	11月29日	第四章：时间序列分析基础
13	12月6日	第五章：时间序列数据建模
14	12月13日	第五章：时间序列数据建模
15	12月20日	第五章：时间序列数据建模
16	12月27日	第六章：面板数据的分析方法
17	1月3日	第六章：面板数据的分析方法

五、教学方式

课堂讲授为主。

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

利用数据库提供的数据资源，经处理后进行演示教学。

七、教材

《本课程讲义》

八、参考书目

1. Introductory Econometrics –A modern approach. Jeffrey M. Wooldridge, 2007.
2. Applied Econometrics --Time Series, Walter Enders, 2004.
3. Time Series –forecasting and control 3rd Edition, Box, Jenkins, Reinsel, 1994,(人民邮电出版社 2005).

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

课程提供 PowerPoint 讲义。

十、课程学习要求及课堂纪律规范

学生要认真阅读教材和参考书目。完成课后作业，超过规定时间一周缴纳的作业不再接受。

十一、学生成绩评定办法（需详细说明评估学生学习效果的方法）

期末考试: 50%

课堂参与: 20%

作业: 30%