

课程大纲

课程编号：02812470

授课对象：研究生

课程名称：金融计量经济学 II

英文名称：Financial Econometrics II

周学时/总学时：3/54

学 分：3

任课教师：王亚平

开课学期：2013 春

先修课程：初级计量经济学

任课教师联系方式：ywang@gsm.pku.edu.cn, 62754805

辅导、答疑时间：周六 9—11am, 2—5pm, 或预约其它时间

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

本课程主要讲授中级计量经济学理论和如何利用计量经济学方法解决金融经济学中的具体问题。计量经济学理论主要包括线性模型的内生问题，离散选择模型及时间系列分析等。计量经济学的应用将基于论文讲解在应用的基本步骤、常见问题及计算机软件。

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

学生将学会中级计量经济学的基本方法和工具，具备利用计量经济学方法分析具体的金融经济学问题的能力。学期结束时，学生将能应用金融计量经济学的方法独立完成一项实证研究。

四、内容提要及学时分配

周次	日期	内容
1	2月27日	Review of OLS
2	3月6日	Panel data
3	3月13日	Instrumental variable estimation (W1-15, W2-5,6)
4	3月20日	Instrumental variable estimation (W1-15, W2-5,6)
5	3月27日	Limited dependent variable models (W1-17, W2-15, 16)
6	4月3日	Limited dependent variable models (W1-17, W2-15, 16)
7	4月10日	time series data (W1-10-12)
8	4月17日	Midterm
9	4月24日	Simple stationary time series models (E.2, T.2)
10	5月1日	Simple stationary time series models (E.2, T.2)
11	5月8日	Stochastic volatility (E.3, T.3)
12	5月15日	Stochastic volatility (E.3, T.3)
13	5月22日	Non-stationary process (E.4)
14	5月29日	Vector autoregression models (E.5, T.8)
15	6月5日	Vector autoregression models (E.5, T.8)
16	6月12日	Cointegration (E.6, T.8)

注：安排将会根据学校放假安排而调整。

五、教学方式

课堂讲解 + 上机

六、教学过程中 IT 工具等技术手段的应用

Powerpoint 及上机演示

七、教材

《Introductory Econometrics: A Modern Approach》, J. M. Wooldridge

《应用计量经济学：时间序列分析》，W. Enders，杜江，谢志超 译 高等教育出版社

八、参考书目

《Analysis of Financial Time Series》，R. S. Tsay

《Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data》, J. M. Wooldridge

九、教学辅助材料，如 CD、录影等

十、课程学习要求及课堂纪律规范

参加讨论、完成作业。

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）

平时成绩 15% + 期中考试 40% + 期末考试 45%

十二、项目培养目标的考核方式与标准（仅适用于参与保障教学效果评估 (Assurance of Learning) 的课程, 该部分可以由教务部门与任课老师沟通后填写, 认证涉及课程: 金融学概论、金融计量经济学 II、证券投资学、实证金融、货币金融理论、金融工程、管理学、微观经济学)