



教學計劃表 Syllabus

課程名稱(中文) Course Name in Chinese	財務金融研究方法		學年/學期 Academic Year/Semester	105/1
課程名稱(英文) Course Name in English	Seminar in Finance Research Methodology			
科目代碼 Course Code	BM_82300	系級 Department & Year	博士	開課單位 Course-Offering Department 企業管理學系
修別 Type	必修 Required	學分數/時間 Credit(s)/Hour(s)	3.0/3.0	
授課教師 Instructor	/林金龍/蕭朝興/呂進瑞			
先修課程 Prerequisite				
課程描述 Course Description				
<p>This is the first part of the course on the research methods in finance. There are five lectures where I shall cover two important topics: event study analysis and matching theory. The first topic assesses the impact of some particular event on the target variables before and after the event. Obviously, the target variables are in time-series context. The second topic estimates the causal treatment effect where cross sectional data are involved. Both are extremely important and useful methods frequently used in finance and economic studies. They both involve, of course, some econometric theory but the core theory are not too difficult to learn. I emphasize their usefulness and focus on the implementation and applications. To achieve this goal, I shall also cover related statistical package which is $\text{\textit{R}}$ in this course. $\text{\textit{R}}$ is a powerful and free statistical packages that contains quite a few useful libraries on event study and matching. It can be downloaded from $\text{\textit{http://www.r-project.org}}$. Students are required to write an empirical project using either one of the two methods. There is no textbook for this course.</p>				
課程目標 Course Objectives				
<p>本課程主要介紹進行金融議題研究時的基本工具，例如研究設計、資料庫使用、研究與實證方法、寫作方式等。主要的議題內容涵蓋三個領域：行為財務、財務工程、財務分析景氣預測等。藉由相關領域的文獻探討各議題的研究方式與寫作技巧、理論架構與資料利用、以及實際進行研究議題設計與撰寫來學習研究的進行方式。期許學生能學習如何撰寫研究論文及論文審閱意見。</p>				
系專業能力 Basic Learning Outcomes				課程目標與系專業能力相關性 Correlation between Course Objectives and Dept.'s Education Objectives
A	具備企業管理理論的核心專業知識			●
B	具備邏輯思考與企業經營管理問題解決的能力			●
C	具備高階財務金融的分析能力			●
D	具備高階企業財務管理專業能力			●

E	具備英語閱讀溝通協調及教學之能力	○
F	具備前瞻開創新興議題之能力	○
G	具備金融創新之能力	○

圖示說明Illustration：● 高度相關 Highly correlated ○ 中度相關 Moderately correlated

授課進度表 Teaching Schedule & Content

週次Week	內容 Subject/Topics	備註Remarks
1	Event study (I): Lin	
2	Event study (II): Lin	
3	Matching (I): Lin	
4	Matching (II): lin	
5	Lab work: Lin	
6	特徵值與橫截面股票報酬: Chiao	
7	三因子之時間序列解釋能力: Chiao	
8	動能策略、52周高點策略: Chiao	
9	四因子模型: Chiao	
10	好股票不等於好投資: Chiao	
11	分析師也會系統性地誤判: Chiao	
12	衡量基金績效的研究方法: Lu	
13	評估基金經理人能力的方法: Lu	
14	基金績效與經理人能力之關聯: Lu	
15	測量基金經理人評估持股異質風險能力: Lu	
16	區分基金經理人評估持股績效能力: Lu	
17	基金經理人能力的持續性及預測性之研究方法: Lu	
18	期末考試週 Final Exam: Lin	

教學策略 Teaching Strategies

- 課堂講授 Lecture
 分組討論 Group Discussion
 參觀實習 Field Trip
 其他 Miscellaneous:

學期成績計算及多元評量方式 Grading & Assessments

配分項目 Items	配分比例 Percentage	多元評量方式 Assessments							
		測驗 會考	實作 觀察	口頭 發表	專題 研究	創作 展演	卷宗 評量	證照 檢定	其他
平時成績 General Performance									
期中考成績 Midterm Exam									
期末考成績 Final Exam									

作業成績 Homework and/or Assignments									
其他 Miscellaneous (_____)									
評量方式補充說明 Grading & Assessments Supplemental instructions									
3人合授， 每人評分比率各佔1/3，評分方式如下： 林：作業 10%， project report 20% 蕭：第一次授課時說明 呂：上台報告及小考各佔50%									
教科書與參考書目 (書名、作者、書局、代理商、說明) Textbook & Other References (Title, Author, Publisher, Agents, Remarks, etc.)									
No textbook Assigned papers									
課程教材網址 (教師個人網址請列在本校內之網址) Teaching Aids & Teacher's Website (Personal website can be listed here.)									
faculty.ndhu.edu.tw/~jlin									
其他補充說明 (Supplemental instructions)									