ปริญญาตรีบริหารธุรกิจ

ภาควิชาการธนาคารและการเงิน คณะพาณิชยศาสตร์และการบัญชี

จุฬาลงกรณ์มหาวิทยาลัย

**ประมวลรายวิชา (Course Syllabus)**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **1.** | **รหัสวิชา** | 2604313 |
| **2.** | **จำนวนหน่วยกิต** | 3 |
| **3.** | **ชื่อวิชา** | Financial Econometrics (เศรษฐมิติการเงิน) |
| **4.** | **คณะ/ภาควิชา** | พาณิชยศาสตร์และการบัญชี/การธนาคารและการเงิน |
| **5.** | **ภาคการศึกษา** | 1 |
| **6.** | **ปีการศึกษา** | 2560 |
| **7.** | **ผู้สอน** | อ.ดร.นราพงศ์ ศรีวิศาล  ภาควิชาการธนาคารและการเงิน ตึกมหิตลาธิเบศร์ ชั้น 12  Office Hours:  Email: narapong@cbs.chula.ac.th  รศ.ดร.วิมุต วานิชเจริญธรรม  ภาควิชาการธนาคารและการเงิน ตึกมหิตลาธิเบศร์ชั้น 10  Office Hours: By appointment  Email: vimut@cbs.chula.ac.th |
| **8.** | **เงื่อนไข** | ต้องผ่านวิชาสถิติธุรกิจ (2603330) |
| **9.** | **สถานภาพรายวิชา** | วิชาบังคับ |
| **10.** | **ชื่อหลักสูตร** | บริหารธุรกิจ |
| **11.** | **ระดับวิชา** | ปริญญาตรี |
| **12.** | **ชั่วโมงสอน/สัปดาห์** | 3 ชั่วโมง (ตอนเรียน 1: พุธ 13:00-16:00 น.; ตอนเรียน 2: ศุกร์ 9:00-12:00 น.) |
| **13.** | **เนื้อหารายวิชา** | การประยุกต์ใช้สถิติและคณิตศาสตร์มาใช้ในการวิเคราะห์ข้อมูล โดยทำการศึกษาถึงเครื่องมือต่างๆ ที่ใช้ รวมถึงการวิเคราะห์ การประยุกต์ใช้โปรแกรมทางคอมพิวเตอร์ และนิสิตสามารถมีความรู้พื้นฐานที่จะทำการวิจัยเบื้องต้นได้ |

**14. ประมวลการเรียนการสอน**

14.1 วัตถุประสงค์

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | Course Objectives | Learning Outcomes\* | Teaching Approach\* | Evaluation Approach\* |
| 1 | Students understand a variety of basic econometric tools and can apply the tools with appropriate assumptions for unprejudiced analysis. | 1.2 In-depth knowledge  2.1 ethical  3.1 think critically  3.3 problem-solving skill  4.4 math/stat skill | 1. Lecture  2. Discussion | 1. Written Exam  7. Homework |
| 2 | Students learn to use statistical software package (e.g. STATA, R) to analyze data with basic econometric models. | 4.3 IT skill | 12. Demonstrate  39. Self Study | 7. Homework |
| 3 | Students are capable of reading and interpreting results estimated by basic econometric models. | 1.2 In-depth knowledge,  3.1 think critically | 1. Lecture  2. Discussion | 1. Written Exam  7. Homework |

14.2 เนื้อหาและตารางสอน

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| สัปดาห์ | หัวข้อการสอน | การบ้าน |
| 1 | Overview, Probabilistic and Statistical Review. (พุธที่ 16 ส.ค./ศุกร์ที่ 18 ส.ค.) |  |
| 2 | Bivariate OLS: Derivation and Interpretations, Properties, and Goodness of Fit. (พุธที่ 23 ส.ค./ศุกร์ที่ 25 ส.ค.) | การบ้าน 1 |
| 3 | Multivariate OLS: Interpretations, Interaction, Multicollinearity, Adjusted Goodness of Fit. (พุธที่ 30 ส.ค./ศุกร์ที่ 1 ก.ย.) |  |
| 4 | Inference and Rescaling (พุธที่ 6 ก.ย../ศุกร์ที่ 8 ก.ย.) | การบ้าน 2 |
| 5 | Heteroskedasticity, GLS, FGLS. STATA Session (พุธที่ 13 ก.ย../ศุกร์ที่ 15 ก.ย.) |  |
| 6 | Endogeneity Problems: Omitted Variable Bias, Measurement Errors, and Simultaneous Equation. (พุธที่ 20 ก.ย../ศุกร์ที่ 22 ก.ย.) | การบ้าน 3 |
| 7 | Problem and Review Session (พุธที่ 27 ก.ย../ศุกร์ที่ 29 ก.ย.) |  |
| 8 | **สอบกลางภาค (ในตาราง) วันพฤหัสที่ 5 ตุลาคม เวลา 13:00 – 15:00 น.** |  |
| 9 | Instrumental Variables and 2SLS (พุธที่ 11 ต.ค./ศุกร์ที่ 13 ต.ค.) |  |
| 10 | STATA session: Financial data and intro to time-series model (พุธที่ 18 ต.ค./ศุกร์ที่ 20 ต.ค.) | การบ้าน 4 |
| 11 | Serial Correlation and Univariate Time Series Models (พุธที่ 25 ต.ค./ศุกร์ที่ 27 ต.ค.) |  |
| 12 | Stationarity and Unit roots (พุธที่ 1 พ.ย./ศุกร์ที่ 3 พ.ย.) | การบ้าน 5 |
| 13 | STATA SESSION: Multivariate Time Series Models (พุธที่ 8 พ.ย./ศุกร์ที่ 10 พ.ย.) |  |
| 14 | ARCH and GARCH Models / STATA session (พุธที่ 15 พ.ย./ศุกร์ที่ 17 พ.ย.) | การบ้าน 6 |
| 15 | Problem and Review Session (พุธที่ 22 พ.ย./ศุกร์ที่ 24 พ.ย.) |  |
|  | **สอบปลายภาค (ในตาราง)** |  |

14.3 สื่อการสอน

กระดาน, PowerPoint Slides,เอกสาร,Blackboard, โปรแกรม STATA

14.4 การวัดผล

สอบกลางภาค 40%

งานและการบ้านครึ่งเทอมแรก 10%

สอบปลายภาค 40%

งานและการบ้านครึ่งเทอมหลัง 10%

นิสิตต้องส่งการบ้านก่อนเริ่มคาบเรียนรายวิชานี้ของวันที่กำหนดส่งและจะไม่มีการรับงานที่เลยกำหนดส่ง นิสิตสามารถปรึกษาและช่วยกันทำการบ้านเป็นกลุ่มได้ เพื่อช่วยในการเรียนรู้ของนิสิตเอง แต่นิสิตแต่ละคนต้องเขียนงานส่งเองโดยระบุชื่อตัวเองและชื่อเพื่อนที่ช่วยกันทำงาน

**15. หนังสือและบทความสำหรับอ่านประกอบ**

Kennedy, P. (2008) “A Guide to Econometrics,” 6th ed., Wiley-Blackwell.

Stock, J. H. and M. W. Watson (2010) “Introduction to Econometrics,” 3rd ed., Addison-Wesley.

Verbeek, M. (2010) “A Guide to Modern Econometrics,” 4th ed., Wiley.

Wooldridge, Jeffrey M. (2013) “Introductory Econometrics: A Modern Approach,” 5th ed., Cengage Learning.

**\*Notes**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Desired Characteristics of Chulalongkorn University Graduates** | | | |
| **Outcomes** | | | |
| 1 | Being knowledgeable | 1.1 | Possessing well-rounded knowledge |
| 1.2 | Possessing in-depth knowledge |
| 2 | Having good morals | 2.1 | Being moral and ethical |
| 2.2 | Having an awareness of etiquette |
| 3 | Having higher order thinking skills | 3.1 | Being able to think critically |
| 3.2 | Being able to think creatively |
| 3.3 | Having skills in problem solving |
| 4 | Possessing essential capabilities | 4.1 | Having professional skills |
| 4.2 | Having communication skills |
| 4.3 | Having skills in information technology |
| 4.4 | Having mathematical and statistical skills |
| 4.5 | Having management skills |
| 5 | Having an inquiring mind and knowing how to learn | 5.1 | Having an inquiring mind |
| 5.2 | Knowing how to learn |
| 6 | Having leadership qualities | | |
| 7 | Maintaining well-being | | |
| 8 | Being community-minded and possessing social responsibility | | |
| 9 | Sustaining Thainess in a globalized world | | |

|  |  |
| --- | --- |
| **Teaching Methods** | |
| 1 | Lecture |
| 2 | Discussion |
| 3 | Seminar |
| 4 | Deductive |
| 5 | Inductive |
| 6 | Case |
| 7 | Role playing |
| 8 | Field work |
| 9 | Field trip |
| 10 | Simulation |
| 11 | Dramatization |
| 12 | Demonstration |
| 13 | Learning center |
| 14 | Game |
| 15 | Experiment |
| 16 | Programmed instruction/Computer-aided instruction/Blended learning/Online learning |
| 17 | Practice |
| 18 | Practicum (including teaching practicum) |
| 19 | Research-based instruction |
| 20 | Problem-based instruction |
| 21 | Reflective thinking |
| 22 | Inquiry-based instruction |
| 23 | Independent study |
| 24 | Self-directed learning |
| 25 | Project-based instruction |
| 26 | Learning from model persons/learned persons |
| 27 | Micro teaching |
| 28 | Supervision |
| 29 | Cooperative learning |
| 30 | Individual advice |
| 31 | Tutorial group |
| 32 | Brain storming |
| 33 | Summary of main topics, or presentation of reading assignment |
| 34 | Apprentice |
| 35 | Activities |
| 36 | Clinical bed-side teaching or patient-based learning |
| 37 | Practice in behavior manifestation |
| 38 | Observation trip |
| 39 | Self study |
| 40 | Others (Please specify) |

|  |  |
| --- | --- |
| **Evaluation Methods** | |
| 1 | Written examination |
| 2 | Oral examination |
| 3 | Skills examination |
| 4 | Behavior observation |
| 5 | Assessment of work processes/activity roles |
| 6 | Assessment of output/lessons based on students' experience |
| 7 | Homework assessment |
| 8 | Report/Project assessment |
| 9 | Diary/Journal assessment |
| 10 | Performance testing |
| 11 | Assessment of report criticism/presentation |
| 12 | Assessment of result of team-work effort |
| 13 | Self assessment |
| 14 | 360 Degrees assessment |
| 15 | Peer assessment |
| 16 | Oral presentation |
| 17 | Class attendance |
| 18 | Others (Please specify) |