



คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ เค้าโครงการเรียนการสอน (Course Syllabus)

๑. รหัสวิชา.....ศ 435.....ชื่อวิชา.....เศรษฐมิติทางการเงินเบื้องต้น.....
๒. ภาคการศึกษา/ ปีการศึกษาที่เปิดสอน : ภาคการศึกษาที่.....1.....ปีการศึกษาที่.....2563.....
วัน และเวลาบรรยาย : ...พุธ และ ศุกร์ เวลา 9.30 น. - 11.00 น. ...Sec/Gr 070001.....
ห้องบรรยาย : ...SC3039.....

๓. อาจารย์ผู้สอน/ ผู้รับผิดชอบรายวิชา

- ๓.๑ อาจารย์ผู้สอน: ผศ. ดร. เฉลิมพงษ์ คงเจริญ
๓.๒ ห้องพัก: ห้องรองคณบดีฝ่ายการนักศึกษา ชั้น 3 อาคาร Y
๓.๓ เวลาเข้าพบ: พุธและศุกร์ เวลา 11-12 น. หรือนัดหมาย
๓.๔ ช่องทางการติดต่อ: อีเมลล์ chaleampong@econ.tu.ac.th

๔. คำอธิบายรายวิชา (และวิชาบังคับก่อน)

(หลักสูตร 2556)

รายวิชาบังคับก่อน: สอบได้ EC325 และ สอบได้ EC431 หรือ
สอบได้ EC425 และ สอบได้ EC431

วิธีการประมาณค่าแบบจำลองเศรษฐมิติทางการเงิน เช่น วิธีการกำลังสองน้อยที่สุด วิธีการ Maximum Likelihood โดยเน้นแบบจำลองสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลา ประกอบด้วย แบบจำลองสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลาเชิงเดี่ยว (Univariate Time-Series) แบบจำลองสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลาที่มีความถี่สูง แบบจำลองสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลาเชิงพหุ (Multivariate Time-Series) การพยากรณ์ทางการเงิน การประมาณค่าแบบจำลองสมการถดถอยที่ตัวแปรที่มีความสัมพันธ์ระยะยาวและการปรับตัวในระยะสั้น และการประยุกต์ใช้แบบจำลองเพื่อการวิเคราะห์ประเด็นทางเศรษฐศาสตร์การเงิน

๕. วัตถุประสงค์ของวิชา

วิชานี้เป็นวิชาที่มีเนื้อหาหลักเกี่ยวกับการประมาณค่าและการอนุมาน (inference) ผลการประมาณค่าจากข้อมูลโดยเน้นไปยังข้อมูลทางการเงินที่มีลักษณะเป็นข้อมูลอนุกรมเวลา (time series data) การเรียนมีการใช้ซอฟต์แวร์ เช่น R เพื่อให้ นักศึกษาสามารถนำความรู้ไปใช้งานได้จริง

๖. ตำรา/ เอกสาร/ สื่อการเรียนการสอน

๖.๑ เอกสารบังคับ

เฉลิมพงษ์ คงเจริญ, เศรษฐมิติทางการเงินเบื้องต้น, 2563 สามารถดาวน์โหลดได้จาก
<https://chaleampong.github.io/EC435/>

๖.๒ เอกสารเพิ่มเติมและสื่อการสอนจะโพสต์ใน <https://chaleampong.github.io/EC435/>

Brooks (B), C. *Introductory Econometrics for Finance*. 2nd Ed., Cambridge University Press, 2008.

Tsay (T), R. *Analysis of Financial Time Series*. 3rd Ed., Hoboken, NJ: John Wiley & Sons, 2010.

๗. หัวข้อการเรียนการสอน/แผนการสอน

สัปดาห์ที่ (Week)	รายละเอียด (Topic/ Content)	กิจกรรมการเรียนการสอน สื่อที่ใช้/หนังสืออ้างอิง
1 (14 ส.ค.)	1. บทนำ: ตัวอย่างอนุกรมเวลาทางการเงิน 2. อนุกรมเวลาทางการเงินและคุณลักษณะทางสถิติ	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 1, 2; T, บทที่ 1)
2 (19, 21 ส.ค.)	2. อนุกรมเวลาทางการเงินและคุณลักษณะทางสถิติ	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 2; T, บทที่ 1)
3 (26*, 28 ส.ค.)	3. แบบจำลองอนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3; T, บทที่ 2)
4 (2, 4 ก.ย.)	3. แบบจำลองอนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3; T, บทที่ 2)
5 (9*, 11 ก.ย.)	3. แบบจำลองอนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3; T, บทที่ 2)
6 (16, 18 ก.ย.)	3. แบบจำลองอนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3; T, บทที่ 2)
7 (23*, 25 ก.ย.)	3. แบบจำลองอนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3; T, บทที่ 2)
สัปดาห์สอบกลางภาค (วันที่ 30 ก.ย. 2563 เวลา 12-14 น.)		
8 (7,9 ต.ค.)	4. สมการถดถอยสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลา	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 4)
9 (14, 16 ต.ค.)	5. แบบจำลองความผันผวน	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 5; T, บทที่ 3)
10 (21* ต.ค.)	5. แบบจำลองความผันผวน	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 5; T, บทที่ 3)
11 (28, 30 ต.ค.)	6. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงพหุ	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 6; T, บทที่ 8)
12 (4*, 6 พ.ย.)	6. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงพหุ	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 6; T, บทที่ 8)
13	7. โคอินทิเกรชัน	เฉลิมพงษ์ บทที่ 7

สัปดาห์ที่ (Week)	รายละเอียด (Topic/ Content)	กิจกรรมการเรียนการสอน สื่อที่ใช้/หนังสืออ้างอิง
(11, 13 พ.ย.)		
14 (18**, 20 พ.ย.)	7. โคอินทิเกรชัน	เฉลิมพงษ์ บทที่ 7
15 (25*, 27 พ.ย.)	7. โคอินทิเกรชัน	เฉลิมพงษ์ บทที่ 7

จะมีการนัดชดเชยวันหยุดสองครั้ง (12 ส.ค. และ 23 ต.ค.)

* วันที่จะมีกิจกรรมเก็บคะแนนในห้องช่วงท้ายชั่วโมง

** วันทดสอบการใช้โปรแกรม R ในห้องคอมพิวเตอร์

๘. การประเมินผล

กิจกรรมที่ (No. of Activities)	วิธีการประเมิน (Assessment methods)	สัปดาห์ที่ประเมิน (Assessment week)	สัดส่วนการประเมิน (Proportion of assessment score)
1	สอบกลางภาค (วันที่ 30 กันยายน พ.ศ. 2563 เวลา 12-14 น.)	8	30
2	สอบปลายภาค (วันที่ 9 ธันวาคม พ.ศ. 2563 เวลา 9-12 น.)	16	45
3	การบ้านเดี่ยว (จำนวน 5 ครั้ง)	1-15	4
4	การทดสอบย่อยและกิจกรรมในห้องเรียน	3, 5, 7, 10, 12, 15	6
5	การทดสอบการใช้โปรแกรม R	14	10
6	กิจกรรมกลุ่ม (จำนวนสมาชิก 3-4 คน)	1-15	5

นโยบายว่าด้วยความสุจริตในการศึกษา

เพื่อความยุติธรรมต่อนักศึกษาที่ใช้ความพยายามในการเรียนอย่างสุจริต นักศึกษาที่กระทำการทุจริตจะได้รับโทษอย่างรุนแรง หากพบว่านักศึกษากระทำความผิดในการบ้านหรืองานที่ส่งในชั้น จะไม่ได้รับคะแนนในงานนั้นๆ ส่วนการกระทำความผิดในการสอบกลางภาคและปลายภาคจะได้รับเกรด “F” และถูกพักการเรียนไม่เกินสองปีการศึกษา การกระทำความผิดที่กล่าวถึงรวมถึงการเอาเอกสารหรือเครื่องมืออิเล็กทรอนิกส์เข้าห้องสอบ การลอกงานของผู้อื่นโดยมิได้อ้างอย่างถูกต้อง การลอก การให้ลอก การทำ หรือให้คนอื่นทำงานที่ต้องส่งในชั้นแทนตนเอง และพฤติกรรมอื่นๆที่เข้าข่ายการกระทำความผิดทางการศึกษาอื่นๆ นอกจากนี้ผู้กระทำความผิดจะถูกส่งให้ทางมหาวิทยาลัยดำเนินการลงโทษต่อไป