



คณะเศรษฐศาสตร์ มหาวิทยาลัยธรรมศาสตร์ เค้าโครงการเรียนการสอน (Course Syllabus)

๑. รหัสวิชา.....ศ 435.....ชื่อวิชา.....เศรษฐมิติทางการเงินเบื้องต้น.....
๒. ภาคการศึกษา/ ปีการศึกษาที่เปิดสอน : ภาคการศึกษาที่.....2.....ปีการศึกษาที่.....2562.....
วัน และเวลาบรรยาย : ...พุธ และ ศุกร์ เวลา 9.30 น. - 11.00 น. ...Sec/Gr 070001.....
ห้องบรรยาย : ...SC2002.....
๓. อาจารย์ผู้สอน/ ผู้รับผิดชอบรายวิชา
๓.๑ อาจารย์ผู้สอน: ผศ. ดร. เฉลิมพงษ์ คงเจริญ
๓.๒ ห้องพัก: ห้องรองคณบดีฝ่ายวางแผน 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)

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 เพื่อให้นักศึกษาสามารถนำความรู้ไปใช้งานได้จริง

๖. ตำรา/ เอกสาร/ สื่อการเรียนการสอน

- ๖.๑ เอกสารบังคับ
เฉลิมพงษ์ คงเจริญ, เศรษฐมิติทางการเงินเบื้องต้น, เอกสารคำสอน
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.
- ๖.๒ เอกสารเพิ่มเติมและสื่อการสอนจะโพสต์ใน <https://chaleampong.github.io/EC435/>

๗. หัวข้อการเรียนการสอน/แผนการสอน

สัปดาห์ที่ (Week)	รายละเอียด (Topic/ Content)	กิจกรรมการเรียนการสอน สื่อที่ ใช้/หนังสืออ้างอิง
1	1. อนุกรมเวลาทางการเงิน (financial time series) และ คุณลักษณะทางสถิติ	(T, บทที่ 1; เฉลิมพงษ์ บทที่ 1)
2	1. อนุกรมเวลาทางการเงิน (financial time series) และ คุณลักษณะทางสถิติ	(T, บทที่ 1; เฉลิมพงษ์ บทที่ 1)
3	2. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง (linear time series analysis)	(T, บทที่ 2; เฉลิมพงษ์ บทที่ 2)
4	2. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง (linear time series analysis)	(T, บทที่ 2; เฉลิมพงษ์ บทที่ 2)
5	2. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง (linear time series analysis)	(T, บทที่ 2; เฉลิมพงษ์ บทที่ 2)
6	2. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง (linear time series analysis)	(T, บทที่ 2; เฉลิมพงษ์ บทที่ 2)
7	2. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงเส้นตรง (linear time series analysis)	(T, บทที่ 2; เฉลิมพงษ์ บทที่ 2)
8	3. สมการถดถอยสำหรับข้อมูลอนุกรมเวลา	(เฉลิมพงษ์ บทที่ 3)
9	4. Conditional heteroskedasticity models	(T, บทที่ 3; เฉลิมพงษ์ บทที่ 4)
10	4. Conditional heteroskedasticity models	(T, บทที่ 3; เฉลิมพงษ์ บทที่ 4)
11	5. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงพหุ (Multivariate time series analysis)	(T, บทที่ 8; เฉลิมพงษ์ บทที่ 5)
12	5. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงพหุ (Multivariate time series analysis)	(T, บทที่ 8; เฉลิมพงษ์ บทที่ 5)
13	5. การวิเคราะห์อนุกรมเวลาเชิงพหุ (Multivariate time series analysis)	(T, บทที่ 8; เฉลิมพงษ์ บทที่ 5)
14	6. Unit-root nonstationary and cointegration	เฉลิมพงษ์ บทที่ 6
15	6. Unit-root nonstationary and cointegration	เฉลิมพงษ์ บทที่ 6

๘. การประเมินผล

กิจกรรมที่ (No. of Activities)	วิธีการประเมิน (Assessment methods)	สัปดาห์ที่ประเมิน (Assessment week)	สัดส่วนการประเมิน (Proportion of assessment score)
1	สอบกลางภาค (วันที่ 2 ต.ค. 2562 เวลา 12-14 น.)	8	35
2	สอบปลายภาค (วันที่ 12 ธ.ค. 2562 เวลา 9-12 น.)	16	50
3	การบ้าน	1-15	5
4	ทดสอบย่อยและกิจกรรมในห้อง	1-15	10

นโยบายว่าด้วยความสุจริตในการศึกษา

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