

## 南臺科技大學 104 學年度第 2 學期課程資訊

課程名稱	時間序列分析
課程編碼	80M03801
系所代碼	08
開課班級	碩研財金一甲
開課教師	李源明
學分	3.0
時數	3
上課節次地點	二 7 8 9 教室 S407
必選修	選修
課程概述	本課程介紹各種不同的時間序列資料，在資料處理(檢定)、轉換、建構模型，以及模型診斷上的理論與實際的操作方法與步驟，本課程是配合研究所(碩士)學生在進行論文寫作之前的進階課程。學生需配合相關的課程進度，按時繳交各項作業與報告。
課程目標	本課程要求學生達到理論與實務配合，對於用在時間序列資料上，一般常見慣用的之實證程序或方法要有充分的認識，並務必以能親自操作套裝軟體軟體完成初步實證研究為學習目標。
課程大綱	<ol style="list-style-type: none"> <li>1.基本概念</li> <li>2.定態時間序列模型</li> <li>3.其他定態時間序列模型</li> <li>4.非定態時間序列模型</li> <li>5.追蹤資料模型</li> </ol>
英文大綱	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Fundamental Concepts</li> <li>2. Stationary Time Series Models</li> <li>3. other Stationary Time Series Models</li> <li>4. Nonstationary Time Series Models</li> <li>5. Panel data Models</li> </ol>
教學方式	
評量方法	
指定用書	時間序列分析:經濟與財務上之應用
參考書籍	<p>Dimitrios Asteriou and Stephen G. Hall(2007), Applied Econometrics: a Modern approach using EViews and Microfit , published by PALGRVE MACMILLAN(指南書局代理)</p> <p>陳旭昇(2009)時間序列分析:總體經濟與財務金融之應用, 東華(新月)書局</p>
先修科目	計量經濟學

教學資源	
注意事項	準時繳交作業或報告 不得在上課期間使用手機等 3C 產品 不得遲到早退 或干擾上課進行
全程外語授課	0
授課語言 1	華語
授課語言 2	
輔導考照 1	
輔導考照 2	