

## 南臺科技大學 105 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 | 一 7 8 9 教室 S404  |
| 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<br>不得在上課期間使用手機等 3C 產品<br>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 |   |