

重新查詢

友善列印

0982學期 課程基本資料

系所 / 年級	財金系碩士班 1年級	課號 / 班別	87M00017 / A
學分數	3學分	選 / 必修	選修
科目中文名稱	時間數列分析	科目英文名稱	Time Series Analysis
主要授課老師	林建志	開課期間	一學年之下學期
人數上限	20 人	已選人數	10人

起始週 / 結束週 / 上課地點 / 上課時間

第1週 / 第18週 / M416 / 星期5第02節
第1週 / 第18週 / M416 / 星期5第03節
第1週 / 第18週 / M416 / 星期5第04節

請各位同學遵守智慧財產權觀念；請勿非法影印。

教學綱要

一、教學目標(Objective)

我們將以深入淺出方式，分析金融資產價格之各種時間數列模型、介紹有用的統計工具並以計量軟體實作，使學生具有理論與實證基本概念，以增進日後獨立研究與專業分析的能力或供未來再深造之學業基礎。

二、先修科目(Pre Course)

計量經濟學

三、教材內容(Outline)

一、AR(1)模型的目的與涵義。二、ARMA模型。三、門檻式自我相關結構轉變模型。四、多變數時間序列模型與迴歸。五、多變量GARCH模型。六、Random Walk與單根。七、共整合。

四、教學方式(Teaching Method)

教授、討論、電腦操作。

五、參考書目(Reference)

時間序列分析-經濟與財務上之應用(二版)楊奕農著

2010/2/26	時間序列分析的基礎	林建志
2010/3/5	時間序列分析的基礎	林建志
2010/3/12	Box-Jenkins的ARMA模型	林建志
2010/3/19	Box-Jenkins的ARMA模型	林建志
2010/3/26	ARMA模型的估計	林建志
2010/4/2	ARMA模型的估計	林建志
2010/4/9	結構轉變的考量	林建志
2010/4/16	結構轉變的考量	林建志

六、教學進度(Syllabi)	2010/4/23 期中考	林建志
	2010/4/30 自我相關條件異質變異模型	林建志
	2010/5/7 自我相關條件異質變異模型	林建志
	2010/5/14 多變數模型與向量自我回歸	林建志
	2010/5/21 多變數模型與向量自我回歸	林建志
	2010/5/28 多變量GARCH模型	林建志
	2010/6/4 多變量GARCH模型	林建志
	2010/6/11 非定態時間序列模型	林建志
	2010/6/18 非定態時間序列模型	林建志
	2010/6/25 期末考	林建志

七、評量方式(Evaluation) 作業30% 期中考30% 期末考40%

八、講義位址(<http://>)

九、教育目標

重新查詢