

淡江大學 107 學年度第 1 學期課程教學計畫表

課程名稱	時間序列分析	授課 教師	陳怡宜 CHEN YI-YI
	TIME SERIES ANALYSIS		
開課系級	經濟四 P	開課 資料	選修 單學期 3學分
	TLYXB4P		
系 (所) 教育目標			
<p>一、厚植核心基礎精實進階專業。</p> <p>二、激勵主動思考培養獨立分析。</p> <p>三、活用專業知能接軌實務應用。</p> <p>四、重視溝通協調強化團隊整合。</p> <p>五、形塑國際視野培育公民意識。</p>			
系 (所) 核心能力			
<p>A. 掌握經濟專業的基本知識。</p> <p>B. 對經濟現象或議題，具基本的解讀能力。</p> <p>C. 瞭解經濟專業與財經實務的基本關連。</p> <p>D. 具備基本經濟專業的溝通、整合能力。</p> <p>E. 瞭解國際經濟的基本概況。</p> <p>F. 瞭解經濟專業與福利議題的基本關連。</p>			
課程簡介	<p>本課程將學習時間序列資料的迴歸分析，內容包括單一時間序列及多元時間序列模型的分析，包括模型估計及假設檢定。同時亦學習計量軟體的操作，讓學生具備實際應用能力。</p>		
	<p>This course focus on the regression analysis of time series data. It includes univariate as well as and multivariate time series models. The analysis includes estimation and hypothesis testing. The course also emphasizes the use of econometric software to analyze real data.</p>		

本課程教學目標與目標層級、系(所)核心能力相關性

一、目標層級(選填)：

- (一)「認知」(Cognitive 簡稱C)領域：C1 記憶、C2 瞭解、C3 應用、C4 分析、C5 評鑑、C6 創造
- (二)「技能」(Psychomotor 簡稱P)領域：P1 模仿、P2 機械反應、P3 獨立操作、P4 聯結操作、P5 自動化、P6 創作
- (三)「情意」(Affective 簡稱A)領域：A1 接受、A2 反應、A3 重視、A4 組織、A5 內化、A6 實踐

二、教學目標與「目標層級」、「系(所)核心能力」之相關性：

- (一)請先將課程教學目標分別對應前述之「認知」、「技能」與「情意」的各目標層級，惟單項教學目標僅能對應C、P、A其中一項。
- (二)若對應「目標層級」有1~6之多項時，僅填列最高層級即可(例如：認知「目標層級」對應為C3、C5、C6項時，只需填列C6即可，技能與情意目標層級亦同)。
- (三)再依據所訂各項教學目標分別對應其「系(所)核心能力」。單項教學目標若對應「系(所)核心能力」有多項時，則可填列多項「系(所)核心能力」。(例如：「系(所)核心能力」可對應A、AD、BEF時，則均填列。)

序號	教學目標(中文)	教學目標(英文)	相關性	
			目標層級	系(所)核心能力
1	讓學生瞭解時間序列的迴歸模型，包括模型的估計及假設檢定。	Learning regression models of time series data. Topics include model estimation and hypothesis testing.	C3	A
2	透過電腦實習讓學生學習如何取得時間序列資料，並根據教授的內容，設立並選出一個最適模型	Learning how to collect the time series data, setup the regression model and choose the correct model	C4	AC

教學目標之教學方法與評量方法

序號	教學目標	教學方法	評量方法
1	讓學生瞭解時間序列的迴歸模型，包括模型的估計及假設檢定。	講述、實作	紙筆測驗、實作、報告、出席狀況
2	透過電腦實習讓學生學習如何取得時間序列資料，並根據教授的內容，設立並選出一個最適模型	講述、實作	紙筆測驗、實作、報告、出席狀況

本課程之設計與教學已融入本校校級基本素養

淡江大學校級基本素養	內涵說明
◇ 全球視野	培養認識國際社會變遷的能力，以更寬廣的視野了解全球化的發展。
◆ 資訊運用	熟悉資訊科技的發展與使用，並能收集、分析和妥適運用資訊。
◇ 洞悉未來	瞭解自我發展、社會脈動和科技發展，以期具備建構未來願景的能力。
◇ 品德倫理	了解為人處事之道，實踐同理心和關懷萬物，反省道德原則的建構並解決道德爭議的難題。
◆ 獨立思考	鼓勵主動觀察和發掘問題，並培養邏輯推理與批判的思考能力。
◇ 樂活健康	注重身心靈和環境的和諧，建立正向健康的生活型態。
◇ 團隊合作	體察人我差異和增進溝通方法，培養資源整合與互相合作共同學習解決問題的能力。
◇ 美學涵養	培養對美的事物之易感性，提升美學鑑賞、表達及創作能力。

授課進度表

週次	日期起訖	內容 (Subject/Topics)	備註
1	107/09/10~ 107/09/16	Introduction	
2	107/09/17~ 107/09/23	ARMA model	
3	107/09/24~ 107/09/30	Stationarity and restrictions for an ARMA models	
4	107/10/01~ 107/10/07	Box-Jenkins model selection (I)	
5	107/10/08~ 107/10/14	Box-Jenkins model selection (II)	
6	107/10/15~ 107/10/21	ARCH processes / Estimating GARCH models	
7	107/10/22~ 107/10/28	Testing for a unit AR root	
8	107/10/29~ 107/11/04	review	
9	107/11/05~ 107/11/11	上機考試	
10	107/11/12~ 107/11/18	期中考試週	
11	107/11/19~ 107/11/25	Autoregressive distributed lag model	
12	107/11/26~ 107/12/02	Dynamic effects and the distributed lag model	

13	107/12/03~ 107/12/09	HAC standard errors and estimation of dynamic causal effects	
14	107/12/10~ 107/12/16	VAR	
15	107/12/17~ 107/12/23	Cointegration	
16	107/12/24~ 107/12/30	review	
17	107/12/31~ 108/01/06	元旦放假	
18	108/01/07~ 108/01/13	期末考試週	
修課應 注意事項			
教學設備		電腦、投影機	
教材課本			
參考書籍		Introduction to econometrics, Stock and Watson (2007) Applied Econometric Time Series, Walter Enders (1995) A Guide to Modern Econometrics, Marno Verbeek (2000)	
批改作業 篇數		6 篇 (本欄位僅適用於所授課程需批改作業之課程教師填寫)	
學期成績 計算方式		◆出席率： 10.0 % ◆平時評量：20.0 % ◆期中評量：30.0 % ◆期末評量： % ◆其他〈報告〉：40.0 %	
備 考		「教學計畫表管理系統」網址： http://info.ais.tku.edu.tw/csp 或由教務處 首頁〈網址： http://www.acad.tku.edu.tw/CS/main.php 〉業務連結「教師教學 計畫表上傳下載」進入。 ※不法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿不法影印他人著作，以免觸法。	