

淡江大學 97 學年度第 2 學期課程教學計畫表

授課科目名稱：時間數列

授課教師：張元

開課班級	財務金融系 三年 B 班					必/選修	必修
學分數	2 學分 2 小時 (單學期 2 學分)			先修科目	無		
教學內容 及進度	週次	月／日	內 容				
	第一週	2/18	時間序列導論				
	第二週	2/25	定態時間序列 I：自我迴歸模型				
	第三週	3/4	定態時間序列 I：自我迴歸模型				
	第四週	3/11	定態時間序列 II：ARMA 模型				
	第五週	3/18	定態時間序列 II：ARMA 模型				
	第六週	3/25	單根與隨機趨勢				
	第七週	4/1	單根與隨機趨勢				
	第八週	4/8	結構性變動				
	第九週	4/15	結構性變動				
	第十週	4/22	期中考試				
	第十一週	4/29	向量自我迴歸模型概論				
	第十二週	5/6	縮減式 VAR				
	第十三週	5/13	結構式向量自我迴歸 I				
	第十四週	5/20	結構式向量自我迴歸 II				
	第十五週	5/27	共整合與向量誤差修正模型				
	第十六週	6/3	ARCH-GARCH 模型				
	第十七週	6/10	時間序列中的 AR 迴歸模型				
	第十八週	6/17	期末考試				
講授方式	※	課堂講授		分組討論		參觀實習	其他 (_____)
教學設備	※	電腦	※	投影機		其他 (_____)	
教材課本	陳旭昇 (2007)，時間序列分析-總體經濟與財務金融之應用，東華書局						
參考書籍	楊奕農 (2005)，時間序列分析，雙葉書廊						
批改作業篇數		備 註		本欄位僅適用於所授課程需批改作業之教師填寫。			
成績考核方式		平時成績：30%			期中考成績：30%		期末考成績：40%
		讀書報告：			其他 (_____):		
備 考	※非法影印是違法的行為。請使用正版教科書，勿非法影印他人著作，以免觸法。						