

時間序列分析

- 教科書：葉小蓁 著 ‘時間數列分析與應用’ (2002) (二版)
- 參考書：(I) 林茂文 ‘時間數列分析與預測’ (1992) (華泰書局)
- (II) G.. Box, G. Jenkins, G. Reinsel : Time Series Analysis, Forecasting and Control. (3rd. ed.) (1994) (華泰)

電腦套裝軟體：SCA，SAS，MINITAB。

課程內容：

- | | |
|-------------------------------------|-------|
| (1) 簡介：複習初統 | (1 週) |
| (2) 平穩時間數列模型 | (2 週) |
| (3) 不穩定時間數列模型 | (1 週) |
| (4) 模型鑑定估計與檢定 | (3 週) |
| (5) 季節性時間數列模型 | (1 週) |
| (6) 預測 | (1 週) |
| (7) 轉換函數模型 | (2 週) |
| (8) 介入模型 | (1 週) |
| (9) 多元時間數列模型 | (2 週) |
| (10) 簡介 ARCH, GARCH 與 EGARCH(若時間許可) | (1 週) |

評分比重：期中考(40%)、期末考(40%)、報告(20%)