

課程：時間序列分析

教科書：葉小蓁著 ‘時間數列分析與應用’ (2006) (三版)

參考書：(I)林茂文著 ‘時間數列分析與預測’ (1992) (華泰)

(II)G. Box, G. Jenkins, G. Reinsel: Time Series Analysis, Forecasting and Control. (4th. ed.). (2008) (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)轉換模型函數 (2 週)

(8)多元時間數列模型 (2 週)

(9)介入模型 (1 週)

(10)簡介 ARCH, GARCH 與 EARCH (1 週)

評分比重：期中考(40%)、期末考(40%)、報告(20%)