

## 97-2 大葉大學 完整版課綱

### 基本資訊

課程名稱	財務時間數列	科目序號 / 代號	1948 / FBM3010
開課系所	財務金融學系	學制 / 班級	大學日間部3年1班
任課教師	林福來	專兼任別	專任
必選修 / 學分數	選修 / 3	畢業班 / 非畢業班	非畢業班
上課時段 / 地點	(三)56 / B406 (五)5 / B406	授課語言別	中文

### 課程簡介

A.管理學院SQ ( Society Quotient ; 社會智商 ) 核心能力之四大構面(SCEP) :

- 1.S-解決問題能力 (洞析力、決策力、執行力)
- 2.C-溝通能力 (傾聽能力、表達能力)
- 3.E-倫理觀 (社會倫理、企業倫理、研究倫理)
- 4.P-專業能力 (管理能力-強調商管知識與技能、研究能力-強調商管研究專業)

B.財務金融系之教育目標

本系教育目標 (WE CARE)在於厚植學生職場之專業財金技能 (W) , 使其具備主動探索與善於溝通的人格特質 (E) , 以及運用財金資訊與分析的能力 (CA) , 進而成為富有責任感與倫理觀 (RE) 之財金專業人才 , 而為企業所樂於雇用。

C.財務金融系之核心能力 : [占課程之比重]

- A1. 具備財金專業能力與國際視野: [32%]
- A2. 能透過合作溝通與創新思考, 主動發掘並解決問題: [9%]
- A3. 擁有財金資訊蒐集、整合與分析應用之能力: [50%]
- A4. 具有責任與倫理素養並願意關懷社會: [9%]

D.本課程描述 :

依據財務金融系之教育目標及核心能力, 本課程期望透過楊奕農(2009)一書的詳細導讀及學期報告的寫作, 讓學生具備分析財務時間數列資料的專業能力, 同時訓練學生具備其他的核心能力。本課程採用循序漸進的方式, 帶領學生瞭解財務時間序列模型的理論基礎, 課程內容包含迴歸模型、ARMA模型、結構性改變議題、VAR模型、因果分析、共整合模型以及ARCH模型的介紹。課程中會搭配 EViews 軟體與系上財經資料庫(Datastream, IFS, TEJ)的使用, 期使同學能針對有興趣的財經議題進行實際操作及分析資料, 培養學生的洞察分析能力及探索能力, 做為未來專題寫作之基礎。同時在課程中也會要求學生在學期報告的寫作上需要具備研究倫理。另外, 本課程並輔導同學考取「TQC Excell」、「TQC Excell進階」以及「MOS」等證照。

### 課程大綱

第一章 時間序列分析的基礎

第二章 Box-Jenkins 的ARMA 模型

- 第三章 ARMA 模型的估計
- 第四章 結構轉變的考量
- 第五章 自我相關條件異質變異模型
- 第六章 多變數模型 與 向量自我迴歸
- 第七章 多變量GARCH 模型
- 第八章 非定態時間序列模型
- 第九章 共整合與誤差修正模型

本課程主要是讓學生具備分析財務時間序列資料的專業能力，並依據系核心能力：「具備商業、管理與財金專業能力與國際視野 (A1)」、「能透過合作溝通與創新思考，主動發掘與解決問題(A2)」、「擁有財金資訊蒐集、整合與分析應用之能力(A3)」及「具有責任與倫理素養，願意關懷社會(A4)」，計劃於每一週培養之核心能力分述如下：

第一週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第二週 ( A1、 A2、 A3 )

第三週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第四週 ( A1、 A2、 A3 )

第五週 ( A1、 A2、 A3 )

第六週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第七週 ( A1、 A2、 A3 )

第八週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第九週 ( A1、 A3 )

第十週 ( A1、 A2、 A3 )

第十一週 ( A1、 A2、 A3 )

第十二週 ( A1、 A2、 A3 )

第十三週 ( A1、 A2、 A3 )

第十四週 ( A1、 A2、 A3 )

第十五週 ( A1、 A2、 A3 )

第十六週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第十七週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

第十八週 ( A1、 A2、 A3、 A4 )

(教學大綱視學習狀況、及資料庫說明會調整)

#### 基本能力或先修課程

統計學。

#### 課程與系所基本素養及核心能力之關連

## 成績稽核

### 教科書(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
無參考教科書				

### 參考教材及專業期刊導讀(尊重智慧財產權，請用正版教科書，勿非法影印他人著作)

書名	作者	譯者	出版社	出版年
無參考教材及專業期刊導讀				

### 上課進度

週次	教學內容	分配時數(%)				
		講授	示範	習作	實驗	其他
1	Introduction、倫理宣導(SCPE)	90	0	0	0	10
2	Reviews of Linear Regression Model(SP)	70	20			10
3	Dynamic Models, Autocorrelation and Forecasting(SP)	70	20			10
4	Dynamic Models, Autocorrelation and Forecasting(SP)	70	20			10
5	Simultaneous Equations Models(SP)	70	20			10
6	Nonstationary Time Series Data and Cointegration(SP)	70	20			10
7	Vector Error Correction and Vector Autoregressive Models(SP)	70	20			10
8	Vector Error Correction and Vector Autoregressive Models(SP)	70	20			10
9	Midterm(SCPE)	70	20			10
10	Time-Varying Volatility and ARCH Models(SP)	70	20			10
11	Time-Varying Volatility and ARCH Models(SP)	70	20			10
12	Nonlinear Time-Series Models(SP)	70	20			10
13	Nonlinear Time-Series Models(SP)	70	20			10
14	Final Project(SCPE)	70	20			10
15	Final Project(SCPE)	70	20			10
16	Final Project(SCPE)	70	20			10
17	Final Project(SCPE)	70	20			10