

99-1 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	1903 / FBM3010
開課系所	財務金融學系	學制 / 班級	大學日間部4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	畢業班
上課時段 / 地點	(二)2 / B207 (三)56 / B207	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		分配時數(%)				
週次	教學內容	講授	示範	習作	實驗	其他
1	課程說明、財務時間數列觀念的介紹	90	0	0	0	10
2	第一章 時間序列分析的基礎	90	0	0	0	10
3	第二章 Box-Jenkins 的ARMA 模型	90	0	0	0	10
4	第三章 ARMA 模型的估計	90	0	0	0	10
5	第四章 結構轉變的考量	90	0	0	0	10
6	第四章 結構轉變的考量	90	0	0	0	10
7	第五章 自我相關條件異質變異模型	90	0	0	0	10
8	第五章 自我相關條件異質變異模型	90	0	0	0	10
9	期中考	5	0	0	0	95
10	第六章 多變數模型 與 向量自我迴歸	90	0	0	0	10
11	第七章 多變量GARCH 模型	90	0	0	0	10
12	第七章 多變量GARCH 模型	90	0	0	0	10
13	第八章 非定態時間序列模型	90	0	0	0	10
14	第八章 非定態時間序列模型	90	0	0	0	10
15	第九章 共整合與誤差修正模型	90	0	0	0	10
16	第九章 共整合與誤差修正模型	90	0	0	0	10
17	期末報告	10	10	0	0	80
18	期末報告	10	10	0	0	80