



課 綱 Course Outline
企業管理學系博士班

中文課程名稱 Course Name in Chinese	時間序列分析				
英文課程名稱 Course Name in English	Time Series Analysis				
科目代碼 Course Code	BM__79400	班 別 Degree	博士班 Ph. D.		
修別 Type	選修 Elective	學分數 Credit(s)	3.0	時 數 Hour(s)	3.0
先修課程 Prerequisite	計量經濟(一)				
課程目標 Course Objectives					
資產過程幾乎都是動態過程，本課程主要目標是以時間序列分析資產動態的模式。					
課程大綱 Course Outline					
1. Fundamental Concept 2. Stationary Time Series Models 3. Nonstationary Time Series Models 4. Forecasting 5. Model Identification 6. Parameter Estimation, Diagnostic Checking, and Model Selection 7. Seasonal Time Series Models					
資源需求評估（師資專長之聘任、儀器設備的配合．．．等） Resources Required (e.g. qualifications and expertise, instrument and equipment, etc.)					
1. 聘請時間數列有專長之教師為適。 2. 教學設備包括個人電腦，及一般軟件如EXCEL，SAS等，投影機及錄放影機。					
課程要求和教學方式之建議 Course Requirements and Suggested Teaching Methods					
上述課程以電腦軟體為輔助工具，並做期中期末考，以做理論與實務之效。					
其他 Miscellaneous					