

國立中正大學課程大綱

__109__ 學年 __第二__ 學期

課程名稱(中文)	計量經濟學(Econometrics II)
先修科目或先備能力	統計學 計量經濟學 I
課程概述	教導同學熟悉時間序列分析(Time Series Analysis)的理論與方法，以便未來進行實証相關的研究時，可以選擇適當的分析工具。必需先修過計量 I 才能選修本課程。
學習目標	熟悉時間序列分析方法 熟悉 Eviews 統計軟體操作 熟悉統計軟體報表閱讀及應用
教科書	Hamilton, James D. (1994), Time Series Analysis, (TSA), New Jersey: Princenton (雙葉代理) Enders, Walter (2015), Applied Econometric Time Series (4th edition), (AET), MA: Wiley(滄海圖書代理) (請尊重智慧財產權，不得非法影印教師指定之教科書籍)

教學要點概述	
教材編選	<input type="checkbox"/> 自編教材 <input checked="" type="checkbox"/> 教科書作者提供
教學方法	<input checked="" type="checkbox"/> 投影片講述 <input checked="" type="checkbox"/> 板書講述
評量方法	<input type="checkbox"/> 上課點名 0% <input type="checkbox"/> 小考 0% <input checked="" type="checkbox"/> 作業 100% <input type="checkbox"/> 程式實作 0% <input type="checkbox"/> 實習報告 0% <input type="checkbox"/> 專案 0% <input type="checkbox"/> 期中考 0% <input type="checkbox"/> 期末考 0% <input type="checkbox"/> 期末報告 0% <input type="checkbox"/> 其它 0%
教學資源	<input type="checkbox"/> 課程網站 <input type="checkbox"/> 教材電子檔供下載 <input type="checkbox"/> 實習網站
教學相關配合事項	作業嚴禁抄襲，若以影印方式繳交者，一律以 50 分計。 本課程必須使用統計軟體進行分析，請同學熟悉 Eviews(www.eviews.com)軟體。
課程進度	

第一週：Eviews 軟體操作介紹/差分方程及滯留運算元介紹(Difference Equations & Lag Operator)
第二週：差分方程及滯留運算元介紹(Difference Equations & Lag Operator)
第三週：差分方程及滯留運算元介紹(Difference Equations & Lag Operator)
第四週：差分方程及滯留運算元介紹/定態 ARMA 過程(Stationary ARMA Process)
第五週：定態 ARMA 過程(Stationary ARMA Process)
第六週：定態 ARMA 過程(Stationary ARMA Process)
第七週：定態 ARMA 過程/預測(Forecasting)
第八週：預測(Forecasting)
第九週：預測/漸近分配原理(Asymptotic Distribution Theory)
第十週：定態 VAR(Stationary VAR)
第十一週：定態 VAR(Stationary VAR)
第十二週：定態 VAR(Stationary VAR)
第十三週：非定態模型介紹(Non-Stationary Models)
第十四週：非定態模型介紹(Non-Stationary Models)
第十五週：非定態模型介紹(Non-Stationary Models)
第十六週：單根 (Unit Root Process)
第十七週：單根 (Unit Root Test)-資料存在結構改變或季節性時的單根檢定方法。
第十八週：期末作業

核心能力

培養經濟領域專業知識
分析經濟問題之能力