

# 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<br>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<br>熟悉 Eviews 統計軟體操作<br>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: Princeton (雙葉代理)<br>Enders, Walter (2015), Applied Econometric Time Series (4th edition), (AET), MA: Wiely(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%<br><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%<br><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。<br>本課程必須使用統計軟體進行分析，請同學熟悉 Eviews( <a href="http://www.eviews.com">www.eviews.com</a> )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