

開南大學 95 年度第二學期 資訊管理 學系、所、中心科目教學計劃表

課程編號	2 2 1 0 M 2 1 0	<input checked="" type="checkbox"/> 必修 <input type="checkbox"/> 選修	授課教師：歐崇明 老師 開課系所：資管 學系 年級班別：碩一年班
班次	01		
課程名稱(中文)		學分數	課程名稱(英文)
時間序列分析		3	Time Series Analysis
教學目標 與內容	介紹時間序列的各種分析方法；進而學習預測時間序列趨勢。學習使用 MATLAB 程序來進行時間序列的模擬以及驗證個種分析方法。		
實施方法	<input checked="" type="checkbox"/> 講解法 <input checked="" type="checkbox"/> 實作法 <input checked="" type="checkbox"/> 討論法 <input type="checkbox"/> 演習法 <input type="checkbox"/> 問答法 <input type="checkbox"/> 其他_____		
評量方式	期中測驗 30 % 期末測驗 30 % 平時成績 40 % 其他_____ 成績□□%		
授課使用及 參考書籍	(請按作者、書名、版別、出版商、發行地、出版年份、起訖頁數順序填寫)。 1. C. Chatfield, The Analysis of Time Series, An Introduction, 5 th ed., Chapman & Hall, 1996 年。 2. F. Diebold, Elements of Forecasting, 3e, Thomson, 2006。 3. 林茂文, 時間數列分析與預測, 三版, 華泰書局。		
科目簡介(可含大綱及教學進度)：			
<p>時間序列分析概論</p> <p>基本描述型方法 (Autocorrelation)</p> <p>時間序列之機率模型</p> <p>Time Domain Estimation (ARIMA)</p> <p>Forecasting</p> <p>Stationary Process of Frequency Domain</p> <p>Spectral Analysis</p> <p>Bivariate Process</p> <p>Linear System</p> <p>State-space Models and the Kalman Filter</p> <p>Non-linear Models</p> <p>Multivariate time-series Modelling</p> <p>Characterizing Cycles</p> <p>Modeling Cycles: MA, AR, ARMA models</p> <p>Forecasting Cycles</p> <p>Forecasting with Regression Models</p> <p>ARCH, GARCH process</p>			
說明：			
1. 授課教師於學期前填寫本表，經課程委員會審核後，影印分送給教師所屬課程委員會召集人，授課班級所屬系、所及教務處課務組；並於開始上課時，將本內容向學生說明。			
2. 本表於 91.4.23 第四次校課程委員會討論通過。			

課程委員會召集人：資管系系主任 王任官 謹啟

授課教師：歐崇明

課務組辦事員 郭惠嫻

課務組
96. 6. 13
收文章