

武汉大学本科国际金融试验班 2019 秋季学期时间序列

课程提纲

授课教师：刘岩

办公室：亮胜楼 B338-2

电子邮件：ulysses1906@163.com

课程网页：<http://www.liuyanecon.com/ug-ts-2019/>

基本信息

- 上课时间地点：周四上午 1-3 节 8:00-10:35，1 区枫教 103
- 答疑时间：周四下午，邮件预约
- 参考资料（*表示主要资料；#表示研究生水平）：
 1. Stock and Watson, *Introduction to Econometrics*, 3rd edition, 2011；影印版，《计量经济学》，格致出版社，2015（*）
 2. Diebold, *Elements of Forecasting*, 4th edition, 2007；中文版，《经济预测基础教程》，机械工业出版社，2012（*）
 3. Tsay, *Analysis of Financial Time Series*, 3rd edition, 2010；中文翻译版，《金融时间序列分析》，人民邮电出版社，2012
 4. 何书元，《应用实践序列分析》，北京大学出版社，2003
 5. Hayashi, *Econometrics*, Princeton University Press, 2000（#）
 6. Hamilton, *Time Series Analysis*, Princeton University Press, 1994；中文翻译版，《时间序列分析》，中国人民大学出版社，2015（#）
 7. Brockwell and Davis, *Time Series: Theory and Methods*, 2nd edition, 1991；影印版，《时间序列的理论与方法》，世界图书出版公司，2015（#）
 8. 其他参考资料在课程中陆续发放

成绩评定

- 平时成绩：9 次作业，各占期末总成绩 5%，合计 45%
- 期末考试：占期末总成绩 55%

课程内容

序号表示学期周次；将根据学校假期方案进行调整；带*内容为选讲，视课程进度决定

1. 课程介绍，导论
2. 概率与统计回顾 I

3. 概率与统计回顾 II
4. 时间序列数据基本特征
5. 国庆假期
6. 平稳时间序列初步
7. ARMA 过程的表示与性质
8. 1-维时间序列模型的回归分析 I
9. 1-维时间序列模型的回归分析 II
10. VAR 模型的性质与分析 I
11. VAR 模型的性质与分析 II
12. 平稳时间序列的谱分析与周期性 (*)
13. 单位根过程及其检验
14. 协整与误差修正模型
15. 随机波动率模型
16. Markov 区制转换模型 (*)
17. 复习

数学基础

- 微积分，线性代数，概率论，统计或计量经济学基础

统计软件

- 课程主要使用 R，欢迎大家自行学习使用 Python

助教信息

- 马兆星, 525617756@qq.com
- 赵雪晴, xueqingzhao123@163.com