

교과목명	금융시계열분석		학수번호	11665001	이수	전선	학점	3
강의시간	월D,수D	강의실						
선수과목			공학인증 이수구분					
교수소속	사회과학대학 응용통계학과	교수성명	황은주	연락처				
e-mail		연구실		지도상담시간				
홈페이지/카페			조교					

강의 개요

Financial time series analysis is concerned with the theory and practice of asset valuation over time. We study the theories and probabilistic characteristics of financial time series models which are used in financial markets. Parametric and nonparametric estimations will be dealt with for linear time series models and nonlinear time series models such as AR, MA, ARMA, ARCH, GARCH as well as high-frequency financial time series.

강의 목표

The objective of this course is to provide some knowledge of financial time series, introduce some statistical tools useful for analyzing these series and gain experience in financial applications of various econometric methods.

강의 진행방법

Lecture with chalk and board

평가요소	성적 평가방법	비율
출석	Attendance will be checked every class meeting	10
중간고사	Midterm exam will be given with 7 problems	35
기말고사	Final exam will be given with 7 problems	35
레포트	Summary and exercise problems in every chapter	20
그룹 프로젝트		0
기타		0
합 계		100

교과목명	금융시계열분석		학수번호	11665001	이수	전선	학점	3
강의시간	월D,수D	강의실	가천관-313,가천관-316					

과제명 및 과제작성 방법안내	제출일	제출물 유형 및 제출방법
Chapter 1, Summary and exercise problems		
Chapter 2, Summary and exercise problems		
Chapter 3, Summary and exercise problems		
Chapter 4, Summary and exercise problems		

* 과제지연시 패널티 기준 : Late homework will be graded with 80% of full grading.

구분	교재명	저자	출판사	출판년도
주교재	Financial Time Series Analysis	E. Hwang		
부교재	Analysis of Financial Time Series, third edition, Ruey S. Tsay, Wiley	R. S. Tsay	Wiley	
참고자료	시계열분석 이론및SAS실습, 이상렬 지음, 자유아카데미	이상열	자유아카데미	

강의 규정 (학습자 유의사항)

장애학생 지원내용

교과목명	금융시계열분석		학수번호	11665001	이수	전선	학점	3
강의시간	월D,수D		강의실	가천관-313,가천관-316				
주차	기간	수업내용 및 학습활동						
1	03/02 ~ 03/08	Financial time series and their characteristics						
2	03/09 ~ 03/15	Stationarity						
3	03/16 ~ 03/22	White noise and linear time series						
4	03/23 ~ 03/29	AR models						
5	03/30 ~ 04/05	Estimation and forecasting in AR models						
6	04/06 ~ 04/12	MA models						
7	04/13 ~ 04/19	ARMA models						
8	04/20 ~ 04/26	Midterm Exam						
9	04/27 ~ 05/03	Unit-root nonstationarity						
10	05/04 ~ 05/10	Seasonal models						
11	05/11 ~ 05/17	ARCH models						
12	05/18 ~ 05/24	GARCH models						
13	05/25 ~ 05/31	Threshold, EGARCH models						
14	06/01 ~ 06/07	Brownian motion, Brownian bridge, Change-point detection						
15	06/08 ~ 06/14	Nonlinear models						
16	06/15 ~ 06/21	Final Exam						