

수업 계획서

2017-08-28

교과목 정보	수업년도	2017	수업학기	2학기	학수번호	ECO2061	수업코드	11044
	교과목명(국문)	재무금융시계열예측			과목구분	전공핵심		
	교과목명(영문)	FINANCIAL TIME SERIES						
	학점	3	강의	3	실습	0		
	설강조직	경제금융학부			관장조직	경제금융학부		
	강의시간							
교강사 정보	소속	서울 경제금융대학 경제금융학부			성명	김명직		
	연락처				E-MAIL			
	홈페이지	na						
수업운영	수업진행형태	일반수업,매체활용수업						
	강의평가유형 (학생비공개)							
교과목개요	<p>Financial Time Series Modeling and Forecasting (FTSMF) studies econometric methods and programming tools that would help (financial) economists to analyze economic and financial time series data in their economics and finance application. FTSMF covers not only traditional time series methods such as ARIMA model, volatility model, state-space model, vector auto-regression, and co-integration models, but also the estimation and forecasting of the nonlinear models such as Markov regime switching model, artificial neural network.</p> <p>- 이과목은 GEN6094(전공현장실습 1)에 참여하고자 하는 학생들에게 강력히 추천하며 2017년 가을학기중 Open Course Ware (OCW)의 형태로 진행될 예정입니다.</p>							
수업목표 및 안내	<p>1. To promote concrete understanding of various time series methods (다양한 시계열분석기법에 대해 명확히 이해합니다.)</p> <p>2. To learn how to apply right methods to solve real problems (실제문제를 해결하는데 있어 올바른 시계열기법을 적용하는 방법을 습득합니다.)</p> <p>3. To enhance programming skill (프로그래밍 기술을 향상시킵니다.)</p>							
세부목표1	단일시계열을 모형화하고 예측을 실행하며 예측성과를 측정할 수 있는 지식을 습득한다.							
세부목표2	다변량시계열을 모형화하고 예측을 실행하며 예측성과를 측정할 수 있는 지식을 습득한다.							
세부목표3	다양한 시계열예측기법을 습득하고 시계열분석 결과를 일목요연하게 제시하는 방법을 습득한다.							
선수과목 안내	통계학입문 또는 계량경제학입문 등 기초 과목							
수강생 유의사항	<p>1. 각 교과목 중 총 수업시간수의 3분의 2이상을 출석하여야만 그 교과목의 시험에 응시할 수 있다.</p> <p>2. 시험관련 부정행위자로 판명되었을 때는 학칙 또는 내규에 의거 해당 교과목의 성적을 취소한다.</p>							

장애학생 수업안내	<p>장애학생은 본 수업과 관련하여 본인 희망시 다음과 같은 지원이 가능합니다. 담당교수 및 장애학생지원센터와 상담 바랍니다. * 공통: 도우미 지원(수업,이동), 대체평가, 별도 시험장소 제공, 선수강 지원, 노트북 사용 * 시각장애: 점자/확대/녹음 교재 및 시험지 제공, 시험시간 연장, 강의자료 텍스트제공 * 청각장애: 지정좌석제, 동영상 자막지원 * 지체장애: 강의실 변경, 지정좌석제, 시험시간 연장 문의) 장애학생지원센터 (서울) 02-2220-0776, (ERICA) 031-400-4502</p>						
교재	순번	교재명	저자	출판사	ISBN	가격	
	1	Applied Econometric Times Series,	Walter Enders	Wiley	978-0470-	na	
부교재	순번	교재명	저자	출판사	ISBN	가격	
	조회된 데이터가 없습니다.						
평가항목	평가항목	비율	평가항목	비율			
	출석	10	퀴즈	0			
	과제	20	중간고사	30			
	토론	0	기말고사	40			
	팀프로젝트	0	학습참여도	0			
	기타 평가항목				비율		
					%		
					%		
					%		
					%		
				%			
합계 100 %							
주별 강의계획 및 과제	1	주제	Introduction: EViews, R, and GAUSS Programming				
		활동사항	시계열분석을 위한 도구들을 탐색합니다.				
	2	주제	STATIONARY TIME-SERIES MODELS				
		활동사항	- ARMA Models. - Stationarity. - Stationarity Restrictions for an ARMA(p, q) Model. - The Autocorrelation Function. - The Partial Autocorrelation Function. - Sample Autocorrelations of Stationary Series. - Box-Jenkins Model Selection. 				
	3	주제	STATIONARY TIME-SERIES MODELS				
		활동사항	- Forecasting - A Model of the Interest Rate Spread. - Seasonality. - Parameter Instability and Structural Change.				
	4	주제	NONSTATIONARY TIME-SERIES MODELS				
		활동사항	- Forecasting				
	5	주제	MODELING VOLATILITY				
		활동사항	- ARCH Processes. - GARCH Models. - Other Models of Conditional Variance.				
	6	주제	MODELING VOLATILITY				
		활동사항	- Multivariate GARCH.				
	7	주제	MODELS WITH TREND				
		활동사항	-Deterministic and Stochastic Trends. -Unit Roots and Regression Residuals. - The Monte Carlo Method. -Dickey-Fuller Tests. - Structural Change. - Panel Unit Root Tests. -The Bootstrap.				

주별 강의계획 및 과제	8	주제	MIDTERM WEEK
		활동사항	
	9	주제	MULTIEQUATION TIME-SERIES MODELS
		활동사항	- Intervention Analysis. - Transfer Function Models and Estimating a Transfer Function. - Introduction to VAR Analysis.
	10	주제	MULTIEQUATION TIME-SERIES MODELS
		활동사항	- The Impulse Response Function. - Structural VARs. - The Blanchard and Quah Decomposition.
	11	주제	COINTEGRATION AND ERROR-CORRECTION MODELS
		활동사항	-Linear Combinations of Integrated Variables. -Cointegration and Common Trends. -Cointegration and Error Correction. -Testing for Cointegration The Engle-Granger Methodology. -The Johansen Methodology. -Error-Correction and ADL Tests.
	12	주제	NONLINEAR TIME-SERIES MODELS
		활동사항	-Linear Versus Nonlinear Adjustment. -Simple Extensions of the ARMA Model.
	13	주제	NONLINEAR TIME-SERIES MODELS
		활동사항	-Regime Switching Models. -Testing For Nonlinearity.
	14	주제	STATE-SPACE MODELS
		활동사항	-Kalman Filter.
	15	주제	SPECIAL TOPICS
		활동사항	TBA
	16	주제	FINAL WEEK
		활동사항	