

正本

國立臺灣大學
嚴慶齡工業發展基金會合設工業研究中心 函

檔號：RND0206
保存年限：3年

地址：106 台北市基隆路 3 段 130 號 1 樓

聯絡人：鄔文娟

聯絡電話：(02)2362-8136 轉分機 42

電子郵件：awu@tl.ntu.edu.tw

傳真：(02)2363-2090

擬辦：

一、登載學校網頁公告周知。

二、來文影送管理學院、科技學院轉相關系所卓參。

三、文陳閱後存。

受文者：國立暨南國際大學

發文日期：中華民國 96 年 5 月 31 日

發文字號：工研字第 0960428 號

速別：速件

密等及解密條件或保密期限：

附件：如文

約聘人員 林容杉

副教授 林容杉

教授 孫同文

教授 葉上樹

國立暨南國際大學

主旨：台大嚴慶齡工業研究中心與中國統計學社將訂於本(96)年 7 月 02 日至 7 月 10 日合辦「2007 應用時間數列分析預測講習會」首先回顧時間數列與金融數列之發展過程及其應用，以案例說明以資訊為基礎的決策過程對企業及政府運作之重要性，特異直偵測介入分析，以及多變量之動態相關性之建模與評估。在金融時間數列方面，將首重風險評估之建模與分析，並針對 ARCH/GARCH 類型之模型加以比較與探討。電腦實習課程將強調方法之實用性。敬請惠予轉知並鼓勵 貴單位同仁（或會員）踴躍報名參加。

說明：

一、預期效益

1. 深入瞭解工商管理、經濟分析及市場與金融時間數列風險評估之主要觀念、方法及模型。
2. 掌握正確的觀念及方法處理當數據與模型有顯著出入之狀況。
3. 有效評估政策改變，特殊事件對工商管理市場及經濟現象之影響。
4. 實際分析經濟及金融數據之特徵及經驗建模過程之實證問題。

二、上課地點：台大嚴慶齡工業研究中心（台北市基隆路三段 130 號）。

三、檢附『2007 應用時間數列分析預測講習會』議程、報名表各乙份。

四、詳細課程資料請見網址：[HTTP://WWW.TL.NTU.EDU.TW](http://www.tl.ntu.edu.tw)，由近期課程進入。

正本：國立暨南國際大學

副本：

主任 陳 永 祥

第 1 頁 共 1 頁

96 年 6 月 6 日 暨南文總字第 0960005489 號



2154-9944

研究發展處



2007 應用時間數列分析預測講習會

課程主旨：

以工商管理、經濟及金融時間數列之分析與預測為主要課題，介紹相關模型及建模策略，並探討當經濟市場現象與模型不符時之處理方式。

課程簡介：

中國統計學社、台大嚴慶齡工業研究中心訂於本(96)年7月02日至7月10日合辦「2007 應用時間數列分析預測講習會」首先回顧時間數列與金融數列之發展過程及其應用，以案例說明以資訊為基礎的決策過程對企業及政府運作之重要性，特異直偵測介入分析，以及多變量之動態相關性之建模與評估。

在金融時間數列方面，將首重風險評估之建模與分析，並針對 ARCH/GARCH 類型之模型加以比較與探討。

電腦實習課程將強調方法之實用性。除提供 SCA 軟體實際操作外，有興趣者亦可申請取得 SCA 實習版軟體。

學習效益：

1. 深入瞭解工商管理、經濟分析及市場與金融時間數列風險評估之主要觀念、方法及模型。
2. 掌握正確的觀念及方法處理當數據與模型有顯著出入之狀況。
3. 有效評估政策改變，特殊事件對工商管理市場及經濟現象之影響。
4. 實際分析經濟及金融數據之特徵及經驗建模過程之實證問題。

師資簡介

- | | |
|--------------|----------------|
| 1. 刁錦震 教授/院士 | 服務單位：芝加哥大學/中研院 |
| 2. 蔡瑞胸 教授/院士 | 服務單位：芝加哥大學/中研院 |
| 3. 劉榮木 教授 | 服務單位：伊利諾大學 |
| 4. 林金龍 研究員 | 服務單位：中央研究院 |
| 5. 陳江 教授 | 服務單位：紐約雪城大學 |

課程費用：

每天 3,000 元，可擇日上課。學生、3 人以上報名或報 2 天課程以上可享折扣優惠。

上課日期	原價	優惠價
一天	3,000	3,000
二天	6,000	5,880 (98 折)
三天	9,000	8,550 (95 折)
四天	12,000	10,800 (9 折)
五天	15,000	12,750 (85 折)

● 主辦單位：台大嚴慶齡工業研究中心

● 合辦單位：中國統計學社

● 地點：台大嚴慶齡工業中心(台北市大安區基隆路三段 130 號)

● 招生對象：工商經理、金融、證券、期貨、財政人員、教師、學生及其他對本課程有興趣者

● 傳真報名：02-2363-2090，或電洽：02-2362-8136 分機 42 鄒小姐

「2007 應用時間數列分析預測講習會」報名表



*姓 名				性別	
*身份證字號				出生年月日	
*畢業(就讀) 學校科系(所)		大學 專科		研究所 (科)系	
*服 務 機 關				*職 稱	
*發 票 抬 頭				*統一編號	
聯絡 方式	通 訊 地 址				
	*電 話				
	*手 機				
	*E - mail				
*課程選單		上課日期	選課日期	原價	優惠價 (6/20 日前完成 繳費者)
		☐ 一天	☐ 7/2 ☐ 7/4 ☐ 7/6 ☐ 7/9 ☐ 7/10	3,000	3,000
		☐ 二天	☐ 7/2 ☐ 7/4 ☐ 7/6 ☐ 7/9 ☐ 7/10	6,000	5,880 (98 折)
		☐ 三天	☐ 7/2 ☐ 7/4 ☐ 7/6 ☐ 7/9 ☐ 7/10	9,000	8,550 (95 折)
		☐ 四天	☐ 7/2 ☐ 7/4 ☐ 7/6 ☐ 7/9 ☐ 7/10	12,000	10,800 (9 折)
		☐ 五天	☐ 7/2 ☐ 7/4 ☐ 7/6 ☐ 7/9 ☐ 7/10	15,000	12,750 (85 折)
*飲食習慣		☐ 葷食 ☐ 素食			
其 他		*表示其欄位必填			