

序言

第 3 版特色

本書自 2007 年初版, 以及 2013 年第 2 版付梓以來, 將近 10 年沒有改版。疏懶多年, 這次會下定決心予以改版, 主要是因為近年來在教學與指導學生撰寫論文的過程中發現, 學生大多使用 EViews 所提供的圖形使用者介面 (Graphical User Interface, GUI) 功能。對於初學者來說, 使用 GUI「即選即得」當然是相當方便, 然而, 唯有撰寫程式檔 (program file) 才能更有效率地完成研究工作。統計與計量軟體程式的撰寫, 已經是現代實證研究者所不可或缺的技能, 希望透過本書的問世, 能夠為對於時間序列研究有興趣的讀者帶來一點幫助。

因此, 第 3 版最大的特色就是, 我們不再介紹圖形使用者介面, 而是強調 EViews 程式的撰寫。值得一提的是, EViews 目前也提供「指令採集」(Command Capture) 功能, 可以讓我們將 GUI 點選的結果複製到程式檔, 對於程式的撰寫很有幫助。

如果讀者想要認識 EViews 的 GUI 點選, 請參閱陳旭昇 (2013)。然而, 在此還是建議要撰寫程式, 理由有三:

1. 重複視窗點選... 很累! (尤其是修改實證模型設定時)。
2. 視窗點選容易產生難以察覺的疏忽或錯誤 (e.g., Reinhart-Rogoff 的 Excel 錯誤)。
3. 視窗點選的操作過程不透明, 不容易被重製 (replicate)。

相較於第 2 版, 第 3 版對於預測模型也有更細膩的討論。我在章節安排與內容上也做了若干調整, 同時也增加了不少習題, 這反映了我這 10 多年的教學心得。我增加了兩個章節, 分別討論 EViews 程式撰寫與時

間序列迴歸分析, 並大幅改寫結構式 VAR (SVAR) 模型的討論, 尤其是在 VAR 與 SVAR 之間連結的部分, 期待透過新的角度切入, 能夠讓對此方法有興趣的讀者, 有更深入的理解與體會。