



國立屏東大學
National Pingtung University

秘書室校務研究與發展中心
Office of Secretariat Center of Institutional Research & Development

Stata 時間序列應用實務工作坊

課程資訊

日期：112 年 8 月 9 日 (星期三)

地點：Google meet 線上課程

講師：國立高雄科技大學 陳昇鴻 教授

時間	課程主題	課程大綱
8:50 ~ 9:10		報到&開場
9:10 ~ 10:00	時間序列基本概念	<ol style="list-style-type: none"> 1. 時間序列資料 2. 時間序列資料性質 3. 時間序列的重要動差 4. 定態時間序列、樣本動差 5. 固定趨勢、季節性 6. 總體與財金時間序列資料
10:10 ~ 11:00	Stata 軟體基本功能介紹與時間序列資料操作	<ol style="list-style-type: none"> 1. Stata 軟體基本功能介紹 2. Stata 軟體基本功能線上操作 3. 時間序列資料 Stata 線上操作
11:10 ~ 12:00	ARMA 模型基本概念	<ol style="list-style-type: none"> 1. 定態時間序列模型 2. 移動平均模型 3. 自我迴歸 AR 模型與其定態條件 4. 一階自我迴歸 AR(1) 模型 5. AR(1) 模型之估計
12:00 ~ 13:30		休息
13:30 ~ 14:20	ARMA 模型 Stata 軟體線上操作	Stata 軟體 ARMA 模型線上操作 <ol style="list-style-type: none"> 1. AR 模型之估計 2. MA 模型之估計 3. ARMA 模型之估計
14:30 ~ 15:20	單根(Unit Root)模型基本概念	<ol style="list-style-type: none"> 1. 隨機漫步模型 2. 非定態時間序列：帶有趨勢之序列 3. 隨機趨勢造成的問題 4. 時間序列的單根檢定
15:30 ~ 16:20	單根 (Unit Root) 模型 Stata 軟體線上操作	Stata 軟體單根模型線上操作 <ol style="list-style-type: none"> 1. Augmented Dickey-Fuller test 2. Phillips-Perron test 3. GLS detrended augmented Dickey-Fuller test
16:20 ~ 16:30		Q & A 時間