

人大经济论坛统计软件培训中心

关于“Stata 学术论文专题”培训班

各行政企事业单位:

当今社会,统计软件已经广泛应用于通讯、医疗、银行、证券、保险、制造、商业、市场研究、科研、教育等多个行业和领域。

统计分析软件不仅在数据处理、计量分析、数据挖掘等方面发挥着优势,而且是学术研究中的一把利器,现代研究工作更看重对数据的计量分析、更看重对客观事实的研究,掌握统计分析软件的应用,无疑有助于学术研究水平和能力的提升,有益于更有效率的产出学术成果。

其中 Stata 是统计中的一个重要软件,对处理统计方法具有重要的价值。北京国富如荷网络科技有限公司联合人大经济论坛统计推出 Stata 学术论文专题培训班,详情如下:

一、 培训时间、地点:

培训时间:2012 年 4 月 20 日-23 日(四天)

培训地点:北京市海淀区 人民大学

授课安排:

- (1) 授课方式:采用 Stata11.0 软件,中文多媒体互动式授课方式
- (2) 授课时间:上午 9:00-12:00, 下午 13:30-16:30(16:30-17:00 答疑)

二、 讲师介绍:

连玉君,经济学博士,副教授。2007 年 7 月毕业于西安交通大学金禾经济研究中心,现任教于中山大学岭南学院金融系。主讲课程为“金融计量”、“计量分析与 Stata 应用”、“实证金融”、“微观经济学”、“公司金融”等。已在《经济研究》、《管理世界》、《金融研究》、《会计研究》、《世界经济》、《统计研究》、《中国管理科学》、《经济学(季刊)》、《Global Finance Journal》、《Frontiers of Business Research in China》等期刊发表论文 30 余篇,出版专著一部。连玉君副教授主持国家自然科学基金项目、教育部人文社科基金项目、广东自然科学基金项目各一项,并参与了多项国家自科和社科基金项目的研究工作。目前已完成 Panel VAR (1800 余行)、Panel Threshold (1200 余行)、Two-tier Stochastic Frontier (500 余行)等计量模型的 STATA 实现程序,并编写过几十个小程序,如 xtbalance.ado、bdiff.ado 等。

三、课程特色和培训内容

(1) 课程特色

“Stata 学术论文专题”是在讲师多年的教学和研究工作基础上形成的,主要特色包括:

(M1) 每个专题讲解一篇正式发表的学术论文,涉及其研究背景、研究方法、Stata 实现方法,以及可能的拓展方向等,注重对实证结果的分析和解读,从而将计量经济学、经济学和金融学理论知识与实际应用有机地结合起来。

(M2) 每一篇论文都附带了完整的 Stata 实现过程(do 文档)和数据,便于大家学习和借鉴论文中的研究

方法。

(M3) 包含了多个自行编写的 Stata 程序，如面板门槛模型、面板 VAR 模型、双边随机边界模型等。

(M4) 分享了论文写作、投稿、修改，以及与编辑部、导师和合作者沟通的技巧。

(2) 培训目标

(G1) 能够独立完成一篇实证分析为主的学术论文（包括数据处理、回归分析、稳健性分析、结果的呈现和解释等），能够采用适当的方法处理实证分析过程中的模型设定、变量选择、内生性问题、稳健性检验等问题，掌握一些基本的规则和技巧。

(G2) 熟练掌握一些常用的计量方法（包括 OLS、非线性最小二乘法、IV-GMM、最大似然估计、面板数据模型、Logit 模型、Bootstrap、随机边界分析、倾向得分匹配分析等）。

(G3) 能够有效使用 Word、EndNote、Google Scholar 等软件和工具，切实提高工作效率。

(3) 课程大纲（共 14 个专题）

T1: 叶德珠、连玉君和黄有光(2012)

叶德珠, 连玉君, 黄有光, 2012, 消费文化、认知偏差与消费行为偏差, *经济研究*, (2): 即将刊出.

计量方法: OLS、FE, 重点讲述模型设定和结果分析

主题: 消费行为

T2: Flannery and Rangan(2006)

Flannery, M. J., K. P. Rangan, 2006, Partial adjustment toward target capital structures, *Journal of Financial Economics*, 79 (3): 469-506.

研究方法: Pooled OLS, 固定效应模型 (FE), 动态面板模型

主题: 资本结构动态调整 (权衡理论、优序融资理论、市场择时理论)

T3: 连玉君和钟经樊(2007)

连玉君, 钟经樊, 2007, 中国上市公司资本结构动态调整机制研究, *南方经济*, (1): 23-38.

研究方法: 非线性最小二乘法 (NLOLS), Stata 程序编写

主题: 资本结构动态调整 (动态权衡理论)

T4: Fazzari, Hubbard, Petersen, Blinder and Poterba(1988)

Fazzari, S., R. Hubbard, B. Petersen, A. Blinder, J. Poterba, 1988, Financing Constraints and Corporate Investment, *Brookings Papers on Economic Activity*, 1988 (1): 141-206.

计量方法: OLS、IV 估计、衡量偏误的处理方法

主题: 融资约束、投资行为、信息不对称理论

T5: Cleary(1999)

Cleary, S., 1999, The Relationship between Firm Investment and Financial Status, *Journal of Finance*, 54 (2): 673-692.

计量方法: 固定效应模型、多元判别分析、Bootstrap 组间差异检验

主题: 融资约束、投资行为

T6: Opler, Pinkowitz, Stulz and Williamson(1999)

Opler, T., L. Pinkowitz, R. Stulz, R. Williamson, 1999, The Determinants and Implications of Corporate Cash Holdings, *Journal of Financial Economics*, 52 (1): 3-46.

计量方法: Pooled OLS、单变量组间差异分析、统计表格和图形

主题: 现金持有、公司治理

T7: Faulkender and Wang(2006)

Faulkender, M., R. Wang, 2006, Corporate Financial Policy and the Value of Cash, *Journal of Finance*, 61 (4): 1957-1990.

计量方法：OLS、稳健性分析、衡量偏误的处理方法

主题：现金持有、融资决策

T8: Chang and Wong(2009)

Chang, E. C., S. M. L. Wong, 2009, Governance with multiple objectives: Evidence from top executive turnover in China, *Journal of Corporate Finance*, 15 (2): 230-244.

计量方法：Logit、多元 Logit

主题：经理人变更、公司治理

T9: Habib and Ljungqvist(2005)、苏治和连玉君(2011)

Habib, M., A. Ljungqvist, 2005, Firm Value and Managerial Incentives: A Stochastic Frontier Approach, *Journal of Business*, 78 (6): 2053-2094.

苏治, 连玉君, 2011, 中国上市公司代理成本的估算——基于异质性随机前沿模型的经验分析, *管理世界*, (6).

计量方法：异质性随机边界分析

主题：公司治理、代理成本估算

相关参考文献：

连玉君和苏治 (2009)、鲁晓东和连玉君 (2011)

T10: Kumbhakar and Christopher(2009)、卢洪友、连玉君和卢盛峰(2011)

Kumbhakar, S., F. Christopher, 2009, The effects of bargaining on market outcomes: Evidence from buyer and seller specific estimates, *Journal of Productivity Analysis*, 31 (1): 1-14.

卢洪友, 连玉君, 卢盛峰, 2011, 中国医疗服务市场中的信息不对称程度测算, *经济研究*, (4): 94-106.

计量方法：双边随机边界分析

主题：劳动经济学、工资议价、卫生经济学、信息不对称程度的估算

T11: 才国伟和连玉君(2011)

才国伟, 连玉君, 2011, 外资控制权、企业异质性与FDI的技术外溢——基于Olley-Pakes半参法的实证研究, *南方经济*, (8): 45-53.

计量方法：Olley-Pakes 半参法

主题：FDI、技术扩散

T12: Hansen(1999)、连玉君和程建 (2006)

Hansen, B., 1999, Threshold Effects in Non-dynamic Panels: Estimation, Testing, and Inference, *Journal of Econometrics*, 93 (2): 345-368.

连玉君, 程建, 2006, 不同成长机会下资本结构与经营绩效之关系研究, *当代经济科学*, (2): 97-103.

计量方法：面板门槛模型、FE

主题：公司金融、融资约束、资本结构

T13: Love and Zicchino(2006)

Love, I., L. Zicchino, 2006, Financial development and dynamic investment behavior: Evidence from panel VAR, *Quarterly Review of Economics and Finance*, 46 (2): 190-210.

计量方法：面板 VAR 模型、GMM

主题：金融发展、投资支出

T14: Lian, Su and Gu(2011)

Lian, Y., Z. Su, Y. Gu, 2011, Evaluating the effects of equity incentives using PSM: Evidence from China, *Frontiers of Business Research in China*, 5 (2): 266-290.

计量方法：倾向得分匹配分析 (Propensity Score Matching, PSM)

主题：公司治理、股权激励

说明：为最大化提高大家听课效果，请从 T1 到 T14 中，选择你最想听的 6 个专题(在报名表备注中说明)，最终，将按照“少数服从多数”的原则来确定讲课的顺序

四、培训费用：

2400 元（含发票、报名费、培训费、资料费）；学生 1200 元（凭学生证报名，无发票）；

差旅及食宿费用自理

汇款方式：支持在线支付，银行汇款等多种方式，详情请查看：

<http://baoming.pinggu.org/paycenter.aspx>

五、报名办法：

在下列地址进入填写报名信息：<http://baoming.pinggu.org/PostMyInfo.aspx?id=92>

联系方式：

[邓老师](#)

电 话：010-68472925

传 真：010-68478566

E_mail: training@pinggu.org

主办单位：

人大经济论坛统计软件培训中心

（北京国富如荷网络科技有限公司）

二零一二年二月十五日