

# 《Stata 暑期特训班》

## 课程大纲

- ◆ 培训时间: 2011 年 7 月 23 日-25 日(三天)
- ◆ 培训地点: 北京市海淀区 人民大学
- ◆ 培训费用: 1800 元(含发票); 学生 1000 元(凭学生证报名, 无发票); 差旅及住宿费用自理
- ◆ 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), 中午提供午餐一份

### ◆ 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”等。已在《Global Finance Journal》、《Frontiers of Business Research in China》、《经济研究》、《管理世界》、《金融研究》、《世界经济》、《统计研究》、《中国管理科学》、《经济学(季刊)》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然科学基金、国家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、gqhet.ado 等。

### ◆ 培训目标

- (1) 熟练掌握 Stata 基本操作命令 (语法结构、帮助文件、do 文档的使用等)
- (2) 熟练运用 Stata 完成复杂的数据处理工作
- (3) 熟练运用 Stata 估计多种计量模型 (OLS、GLS、NLS、MLE、Panel Data)、掌握最新的 GMM、Bootstrap 等计量方法
- (4) 能运用 Stata 独立完成一篇论文的数据处理和实证分析工作。

## ◆ 课程特色

Stata 培训课程以实证分析为导向, 强调计量理论和应用的结合。在讲解每一个计量模型的过程中, 我们会首先介绍该模型的基本理论和基本思想, 进而结合实例讲解该模型在 Stata 中的操作方法。课程的主要特色包括:

- (1) 注重计量理论与 Stata 软件操作的结合
- (2) 通过大量的实例分析将 Stata 操作与实证研究工作结合起来
- (3) 深入浅出地讲解了 GMM、Bootstrap 等近十年中得到快速发展和应用的计量方法
- (4) 附赠详细的配套资料供学员课后学习、演练

## ◆ 课程简介

在三天的时间里系统地掌握 Stata 并非易事。如果把掌握 Stata 比作登顶珠峰, 那么, 我们期望做到的是: 教会大家最基本的登山技巧, 给你一份地图和一个指南针, 以便协助你顺利完成这个痛并快乐着的旅程。为此, 我们精选了六个专题, 一方面帮助大家掌握 Stata 的基本操作命令, 另一方面学会常用的计量分析模型。课程详情如下:

(1) 在前两个专题中, 我们重点介绍 Stata 入门知识和数据处理。通过这个两个专题的学习, 大家能够清晰地了解 Stata 的整体架构, 能够熟练地处理缺漏值、离群值, 对复杂数据进行合并和拆分, 并通过基本统计量、直方图、箱型图等多种工具了解数据的分布特征。

(2) 在第三和第四个专题中, 分别介绍线性回归模型和非线性回归模型。这里包括了 OLS、GLS、NLS、MLE 等估计方法。熟练掌握这些方法已经能够满足多数实证分析的工具需求了。

(3) 在第五个专题中, 重点介绍常用的 Panel Data 模型, 包括固定效应模型 (FE)、随机效应模型 (RE)、动态面板模型、面板门槛模型等。随着面板数据资料获取难度的降低, 这些模型的掌握能帮助我们更为深入地分析数据中所蕴含的信息。

(4) 在第六个专题中, 深入介绍 Stata 编程知识。主要包括: 条件语句、循环语句、输入项和输出项的设定、子程序、暂时性物件等内容。这些内容的学习有助于进一步提高大家的分析能力。

## ◆ 培训配套资料

(1) 本课程中使用的 do 文档和 ado 文档 (包含每个专题对应的 do 文件, 共计 1 万余行命令, 同时提供 Stata 和 PDF 两种格式, 前者方便学员练习, 后者方便学员阅读)

(2) 范例数据 (STATA 官方范例数据包)、中国宏观经济、中国上市公司范例数据

(3) STATA 外部命令包: plus (包含 400 多个外部命令)

## 课程大纲

专题名称	授课内容	
第 1 讲 Stata 入门概述	数据的导入和导出 执行指令和基本统计分析 do 文件和 log 文件的使用 帮助文件的获取和外部命令的使用 Stata 程序基础 (暂元、条件语句、循环语句等)	
第 2 讲 数据处理	不同数据格式的转换 重复样本值、缺漏值和离群值的处理 数据的横向合并和纵向追加 文字变量的处理 时间序列资料的处理 面板数据资料的处理	
第 3 讲 线性回归模型	普通最小二乘法 (OLS) 广义最小二乘法 (GLS) 模型的设定和筛选 Bootstrap、Jackknife 及稳健性标准误的获取 估计结果的呈现和分析	
第 4 讲 非线性回归模型	非线性最小二乘法 (NLS, 重点介绍程序的编写) 最大似然估计 (MLE, 重点介绍程序的编写)	
第 5 讲 Panel Data 模型	静态面板模型: 固定效应和随机效应 异方差和序列相关 (稳健型标准误的获取) 动态面板模型 (FD-GMM、SYS-GMM) 面板门槛模型 (Panel Threshold Model) 各种面板估计方法的模拟分析	
第 6 讲 Stata 程序	Stata 程序的基本架构 暂时性对象 (暂元、暂时性变量、暂时性文件等) 控制语句 (条件语句、循环语句) Stata 中的各类函数 输入项和输出项的设定 复杂程序 (子程序、可分组执行的程序、可重现结果的程序等)	
第 7 讲(备选) Bootstrap、Jackknife 和 Monte Carlo Simulation	模拟数据的产生 常用分布及其模拟 Bootstrap 及其应用 Jackknife 及其应用 Monte Carlo 模拟分析	说明: 为了增加课程设置的灵活性, 我们另外设定了两个“备选”专题。最终, 将按照“少数服从多数”的原则来确定具体讲解的内容。
第 8 讲(备选) Stata 绘图	Stata 绘图命令的基本架构 常用图形概览 选项的设定 图形元素属性的设定 复杂图形的绘制	

### ◆ 培训优惠及注意事项

参加特训班的学员, 可享受 **5折** 优惠购买 Stata 初级视频教程, 详情参见:

Stata 初级视频教程: <http://baoming.pinggu.org/Default.aspx?id=16>

### ◆ 报名流程及咨询

1. 提交报名信息: <http://baoming.pinggu.org/Default.aspx?id=81>
2. 给予反馈, 确认报名信息
3. 交费: <http://baoming.pinggu.org/paycenter.aspx>
4. 开课前一周发送培训教室路线图, 培训现场领取发票

### ◆ 联系方式

电话: (010)68472925

QQ: 619492407

邮箱: [training@pinggu.org](mailto:training@pinggu.org)

MSN: [pinggu.training@hotmail.com](mailto:pinggu.training@hotmail.com)