

《Stata 暑期高级班》 课程大纲

- ◆ **培训时间:** 2011 年 7 月 26 日-28 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) 熟练运用 Stata 进行静态面板数据模型 (FE 和 RE)、动态面板数据模型 (FD-GMM、SYS-GMM)、事件研究法 (Event Study) 的估计、检验和分析。
- (2) 掌握面板门槛模型 (Panel Threshold Model)、面板 VAR 模型、面板 Logit 模型的理论基础和 Stata 估计方法, 能够在实证分析过程中合理运用这些模型。
- (3) 掌握随机边界分析的理论基础和 Stata 实现方法。对于单边随机边界模型, 要能够熟练运用 Stata 进行估计和效率的测算; 对于异质性随机边界模型、双边随机边界模型、状态转换随机边界模型 (程序由连玉君老师提供), 要理解程序的编写原理、思路和应用方法。
- (4) 理解各种解决内生性问题的方法和计量模型。能熟练运用 IV/GMM、倍分法处理一般的内生性问题, 掌握 Heckman 模型、倾向得分匹配分析 (PSM)、断点回归 (RDD) 的基本原理和 Stata 实现方法。

◆ 课程特色

Stata 暑期高级培训班以实证分析为导向, 强调计量理论和应用的结合。培训内容的设定反映了当前实证分析过程中使用的一些前沿方法。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。课程主要特色包括:

- (1) 注重主流方法和前沿方法的结合。课程中一方面介绍了静态面板模型、单边随机边界模型 (Stochastic Frontier Model)、事件研究法 (Event Study) 等应用已经非常广泛的模型, 另一方面则进一步介绍了动态面板模型 (Dynamic Panel Data)、双边随机边界模型 (Two-tier Stochastic Frontier Model)、自抽样 (Bootstrap)、倾向得分匹配分析 (PSM)、断点回归 (Regression Discontinuity) 等在最近十年中日益受宠的计量模型和估计方法。
- (2) 注重计量理论和实证分析实践的衔接。通过大量的实例分析将 Stata 操作与实证研究工作结合起来。在课时有限的情况下, 我们在课堂上重点介绍各个模型的理论基础和 Stata 实现方法。有关这些方法的拓展和应用, 我们会提供 10-15 篇经典的文献供和部分文献的 Stata 实现过程 (do 文档) 大家课后阅读。
- (3) 附赠详细的配套资料供学员课后学习、演练。

◆ 课程简介

这份经过多次讨论和修改的培训大纲具有非常鲜明的特色。

- (1) 在内容安排上, 我们兼顾了应用的广泛性和前沿性。最为核心的内容是 Panel Data 模型, 尤其是动态面板模型、面板门槛模型、面板 VAR 模型的介绍, 在面板数据越来越容易获取的今天, 能够合理运用这些模型, 无疑会大幅提高我们的洞察力。对于令人颇为棘手的内生性问题, 我们也提供了多种模型, 包括传统的 IV-GMM 估计、倍分法、Heckman 选择模型, 以及近十年中日益受宠的倾向得分匹配分析、断点回归分析等。于此同时, 我们还在此次培训中加入了事件研究法和随机边界分析两个主题, 从而在很大程度上丰富了诸位的工具包。
- (2) 在授课形式上, 我们兼顾了理论基础和 Stata 操作实践。任何计量模型都有其前提假设和适用范围, 否则在应用过程中便缺乏信心。然而, 对于前期基础较为薄弱的学员而言, 繁冗的推导过程往往使我们望而生畏。为此, 我们一方面通过 PDF 讲义详细呈现各个模型的理论基础, 另一方面则通过大量的 Stata 实例来阐释这些计量理论背后所蕴含的经济意义, 并附赠数篇经典文献供各位研读和拓展。简言之, 培训的目标不仅在于教会你“如何操作”, 更在于“为何如此操作”。
- (3) 最后, 在培训的组织形式上, 我们努力为大家营造一个学术交流的小平台。在网络如此便捷的今天, 获得培训中所涉及的计量模型的介绍性文档和资料并非难事。然而, 在强调团队精神的大趋势下, 如何实现优势互补、互通有无则显得尤为重要。为此, 我们会通过制作通讯录、分组讨论等多种方式来促进大家的交流。

◆ 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 (3 小时) Panel Data 模型 I	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)
第 2 讲 (3 小时) Panel Data 模型 II	面板门槛模型 (Panel Threshold Model) 面板 VAR 模型 (Panel VAR Model) 面板 Logit 模型 (Panel Logit Model) 各种面板估计方法的模拟分析
第 3 讲 (3 小时) 事件研究法 (Event Study)	事件研究法的理论基础 事件研究法的 Stata 实现 实例分析: 兼并收购 (M&A) 的市场反应
第 4 讲 (6 小时) 随机边界分析 (SFA)	传统的 SFA 模型 (Traditional Stochastic Frontier Model) 异质性 SFA 模型 (Heteroscedastic Stochastic Frontier Model) 面板 SFA 模型 (Panel Stochastic Frontier Model) 双边 SFA 模型 (Two-tier Stochastic Frontier Model) 状态转换的 SFA 模型 (Regime-Switching Stochastic Frontier Model) 效率的估计和分析
第 5 讲 (6 小时) 处理效应模型 (Treatment Effects)	内生性问题简介 工具变量法和广义矩估计 (IV-GMM) 倍分法 (Difference-in-Difference, DID) Heckman 选择模型 (Heckman Selection Model) 倾向得分匹配分析 (Propensity Score Matching, PSM) 断点回归 (Regression Discontinuity Designs, RDD)
第 6 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 基本原理 Bootstrap 应用实例 Jackknife 及其应用 模拟分析
第 7 讲 (备选) Stata 程序	Stata 程序的基本架构 暂时性对象 (暂元、暂时性变量和文件等) 控制语句 (条件语句、循环语句) Stata 中的各类函数 输入项的设置 输出项的设置 程序的调试 复杂程序 (子程序、可分组执行的程序等)

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。

◆ 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 高级视频教程, 详情参见:

Stata 高级视频教程: <http://baoming.pinggu.org/Default.aspx?id=25>

◆ 报名流程及咨询

1. 提交报名信息: <http://baoming.pinggu.org/Default.aspx?id=82>
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

MSN: pinggu.training@hotmail.com