



武汉大学  
WUHAN UNIVERSITY



# 会计研究中Stata基础命令解析 ——以债券市场数据为例

林晚发 武汉大学

2021年Stata洞察数据科学大会

(1) 数据导入:

cd 路径

import excel using excel\_name.xls, first clear

insheet using xx.txt, clear

insheet using xx.csv, clear

文件较大:

set excelxslargefile on

## (2) 两个文件合并:

- a. 两个文件都是dta文件, 确定主表与附表
- b. 确定合并的关键词
- c. 确定关键词的名字、属性与内容是否一致
- d. `merge m:m keywords using xx.dta`
- e. 删除附表多余的数, `drop if _m`
- f. `drop _m`

### (3) 外部命令的安装:

findit command

ssc install command

其他学者写的命令:

需要把命令压缩包下载，在stata安装包下，找到ado文档下的base文件下里

#### (4) 回归命令:

```
xi: reg y x i.ind i.year
```

```
xi:reg y x i.code i.year
```

```
xi:areg y x i.year, a(code)
```

```
xi:reghdfe y x ,a(code year)
```

\*\*\*\*行业-年度固定效应

\*\*\*\*标准误聚类调整

## (5) 其他一些小tips:

- a. qui
- b. set more off
- c. missing()
- d. return list    ereturn list
- e. group()

(6) 结果输出:

- a. `logout, save(tablename) excel replace: tabstat varlist, stats(n mean sd min p25 p50 p75 max) c(s) f(%10.3f)`
  
- b. `logout, save(tablename) excel replace: pwcorr_a varlist`
  
- c. `outreg2 using result_1.xls, stats(coef tstat) aster(coef) bdec(3)tdec(2) adds(Adj_R2,e(r2_a)) replace or append`

(7) 分行业分年度回归:

a. `bys ind year: reg y x`

`predict res1,res`

b. `bys ind year: asreg y x`



## (8) 组间系数差异检验:

```
sysuse auto, clear
```

```
reg price wei mpg length if foreign==1
```

```
est store F
```

```
reg price wei mpg length if foreign==0
```

```
est store D
```

```
suest F D
```

\*-联合检验

```
test [F_mean = D_mean], cons
```

\*-检验单个系数 [方程名称]变量名称

```
test [F_mean]weight = [D_mean]weight
```

***Thank You!***

