

Stataコマンド用例集

S19

経済系機能編

*Math*工房

EC01A

1. パネルデータ分析機能

機能区分/コマンド	whitepaper タイトル	リンク
パネルデータ分析の基本		
—	XT 推定法の特質	mwp-437
—	日付/時間情報の入力	mwp-001
xtset	パネルデータの定義	mwp-010
パネルデータ推定法		
xtabond	Arellano-Bond 推定法	mwp-175
xtdpd	線形動的パネルデータ推定法	mwp-177
xtdpdsys	Arellano-Bover/Blundell-Bond 推定法	mwp-176
xtgee	一般化推定方程式	mwp-165
xtgee postestimation	xtgee 推定後機能	mwp-166
xtgls	一般化最小 2 乗法	mwp-170
xtivreg	操作変数法による線形回帰モデル	mwp-172
xtlogit	ロジスティック回帰モデル	mwp-019
xtlogit postestimation	xtlogit 推定後機能	mwp-168
xtnbreg	負の二項モデル	mwp-246
xtprobit	プロビット回帰モデル	mwp-497
xtprobit postestimation	xtprobit 推定後機能	mwp-498
xtreg	線形回帰モデル	mwp-017
xtreg postestimation	xtreg 推定後機能	mwp-167
xtregar	AR(1) 擾乱を持つ線形回帰モデル	mwp-171
xtstreg	変量効果生存時間モデル	mwp-247
xtstreg postestimation	xtstreg 推定後機能	mwp-248
xtvar	パネルデータ用 VAR モデル	mwp-479
xtvar postestimation	xtvar 推定後機能	mwp-480
推定支援機能		
xtcointtest	パネルデータ共和分検定	mwp-360
xtunitroot	パネルデータ単位根検定	mwp-245

2. 単変量時系列データ分析機能

機能区分/コマンド	whitepaper タイトル	リンク
単変量時系列分析の基本		
—	単変量時系列コマンド	mwp-486
—	単変量時系列分析	mwp-083
—	日付/時間情報の入力	mwp-001
tsset	時系列データの定義	mwp-002
単変量時系列データ推定法		
arch	ARCH 系モデル	mwp-051
arch postestimation	arch 推定後機能	mwp-056
arima	自己回帰移動平均モデル	mwp-003
arima postestimation	arima 推定後機能	mwp-055
newey	Newey-West 標準誤差	mwp-415
newey postestimation	newey 推定後機能	mwp-416
prais	Prais-Winsten, Cochrane-Orcutt 回帰	mwp-417
regress postestimation	regress - 時系列用推定後機能	mwp-279
推定支援機能		
arimasoc	ARMA 用ラグ次数選択	mwp-466
corrgram/ac/pac	コレログラムの作成	mwp-009
dfgls	DF-GLS 単位根検定	mwp-053
dfuller	Dickey-Fuller 単位根検定	mwp-052
estat sbknown	構造変化の検定 (日付既知)	mwp-271
estat sbsingle	構造変化の検定 (日付未知)	mwp-272
pperron	Phillips-Perron 単位根検定	mwp-054

3. 多変量時系列データ分析機能

機能区分/コマンド	whitepaper タイトル	リンク
多変量時系列分析の基本		
—	多変量時系列コマンド	mwp-487
多変量時系列データ推定法 - VAR/VEC 関連		
var intro	VAR モデルの概要	mwp-207
varbasic	VAR(ベクトル自己回帰) モデル (簡易版)	mwp-005
var	VAR(ベクトル自己回帰) モデル	mwp-004
svar	構造型 VAR モデル	mwp-007
vec intro	VEC モデルの概要	mwp-008
vec	VEC (ベクトル誤差修正) モデル	mwp-063
多変量時系列データ推定法 - その他		
dfactor	動的因子モデル	mwp-277
dfactor postestimation	dfactor 推定後機能	mwp-278
lpirf	局所射影による IRF 推定	mwp-493
lpirf postestimation	lpirf 推定後機能	mwp-494
sspace	状態空間モデル	mwp-275
sspace postestimation	sspace 推定後機能	mwp-276
推定支援機能		
fcast compute	VAR/VEC の動的予測	mwp-068
fcast graph	VAR/VEC 動的予測のプロット	mwp-069
forecast	経済モデルの予測	mwp-234
irf	IRF 系コマンドの用法	mwp-006
irf create	IRF/DMF/FEVD の算出	mwp-384
irf graph	IRF/DMF/FEVD のグラフ化	mwp-385
irf table	IRF/DMF/FEVD のテーブル化	mwp-386

次ページに続く

機能区分/コマンド	whitepaper タイトル	リンク
推定支援機能		
<code>vargranger</code>	Granger 因果性検定	mwp-062
<code>varlmar</code>	VAR の残差自己相関	mwp-059
<code>varnorm</code>	VAR 擾乱の正規性検定	mwp-060
<code>varsoc</code>	ラグ次数選択	mwp-057
<code>varstable</code>	VAR の安定性	mwp-058
<code>varwle</code>	ラグ除外性検定	mwp-061
<code>veclmar</code>	VECM の残差自己相関	mwp-066
<code>vecnorm</code>	VECM 擾乱の正規性検定	mwp-067
<code>vecrank</code>	VECM の共和分ランク	mwp-064
<code>vecstable</code>	VECM の安定性	mwp-065