1.数据合并与整理

2.变量设置

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 变量类型 | 变量名称 | 变量符号 | 变量定义 |
| 被解释变量 | 城乡收入差距 | Theil | 泰尔指数计算城乡收入差距 |
| 解释变量 | 数字普惠金融 | Duf | 数字普惠金融/100 |
| 控制变量 | 经济水平 | lnGdp | GDP取对数 |
| 外贸依存度 | Foreign | 进出口总额/GDP  //使用年度平均汇率转化进出口总额单位为人民币后测算得到 |
| 产业结构高级化 | High | 冯素玲-产业结构高级化 |
| 产业结构合理化 | Rat | 产业结构合理化泰尔指数倒数 |
| 城市化建设 | Urb | 城镇人口/总人口 |
| 教育水平 | Edu | 人均高校在校生人数 |
| 创新发展 | Innov | 人均专利数量 |

3.模型构建

4.相关性分析

5.多重共线性检验

6.基准回归 （模型检验）

7.异方差检验 组内自相关检验 截面相关

1.异方差存在

2.自相关存在

3.截面相关存在

组间异方差 xttest3

组内自相关 xtserial

截面相关

长面板 xttest2；

平衡面板/非平衡面板/动态面板 xtcsd,pes

平衡面板/不考虑时间效应xtcsd,fri

平衡面板/考虑时间效应xtcsd,fre

资料来源

<https://zhuanlan.zhihu.com/p/112976758>

<https://zhuanlan.zhihu.com/p/506510639>

8.修正

组间异方差

Xtpcse ,hetonly

组内自相关

Xtpcse ,corr(psar1) // xtpcse ,corr(ar1)

组间异方差+组内自相关

Xtpcse 什么都不加

Xtreg ,fe r

三个问题都存在

长面板 （xtgls xtscc）

短面板 （慎用xtscc 不用xtgls）

资料来源：

<https://www.bilibili.com/video/BV1PT4y1V78W/?spm_id_from=333.788.videocard.16&vd_source=2558b6cdbf562f5a31b5ca8f49bf87db>

9.内生性

//检验

//无异方差

xi:reg theil duf duf2 lngdp foreign urb edu innov high rat i.year i.id

est store ols

xi:ivregress 2sls theil (duf=l.duf l2.duf) lngdp foreign urb edu innov high rat i.year i.id

est store iv

hausman iv ols

hausman iv ols,c sigmamore

//异方差DWH

xi:ivregress 2sls theil (duf=l.duf l2.duf) lngdp forign urb edu innov high rat i.year i.id

estat endogenous

资料来源：https://blog.csdn.net/weixin\_42711949/article/details/107642265

内生性修正：

IV-GMM

SYSGMM

10.分组回归+倒U曲线

11.门限效应