

[首页](#)[概况](#)[研究机构](#)[学者介绍](#)[成果文库](#)[文献数据](#)[培训教育](#)[对外交流](#)

Search the Web

Find It

 您的位置： [首页](#) → [主页内容](#) → [数技通讯](#)

## 美国学者在我院举办面板数据讲座受到热烈欢迎

应我院数量经济与技术经济研究所邀请，美国南加州大学教授、著名华裔经济计量学家萧政教授(Cheng Hsiao)于8月16日—8月17日在我院进行了主题为“面板数据分析”的学术讲座。面板数据分析是近年来经济计量学领域最为活跃的研究前沿之一，萧政教授多年从事面板数据的研究工作并取得了丰富的研究成果，成为这一领域最负盛名的专家之一。

面板数据(panel data)指在时间序列上取多个截面，在这些截面上同时选取样本观测值所构成的样本数据，也就是把截面和时间序列数据融合在一起的数据。在这次讲座上，萧政教授着重介绍了面板数据分析的基本内容，包括面板数据的主要特点，面板数据模型的设定(固定效应模型与随机效应模型)，面板数据模型的估计(LSDV估计与GLS估计)、面板数据模型的选择(Hausman检验)，以及动态面板数据的设定与估计(GMM方法)问题等。

面板数据模型最早应用于对微观个体行为的研究，它也因此成为微观经济计量学的重要分支之一。近些年来，在对宏观经济分析中也越来越多地引入了面板数据模型，比如经济增长领域中的收敛问题，消费领域中的地区差异性问题等。与微观面板数据不同的是，宏观面板数据往往表现出时间维上较长的延续性，因此，时序分析中的伪回归、单位根、协整问题也不可回避地存在于面板数据模型之中。有关面板数据的单位根检验，协整分析，以及面板数据的VAR模型也成为这一方向的研究前沿。萧政教授也就此问题简单地介绍了宏观面板数据研究的一些情况。

萧政教授长期从事计量经济学研究与教学，为面板数据研究领域的权威学者。萧政教授早年就读于台湾大学和英国牛津大学，随后在美国斯坦福大学先后获得统计学硕士、经济学博士学位，毕业后曾先后在美国加州柏克利大学、加拿大多伦多大学、美国南加州大学经济学任教，现为美国南加州大学经济系教授，是世界经济计量学会成员(Member of Econometrics Society)，《Journal of Econometrics》编委，台湾“中央研究院”院士，同时还在美洲、欧洲、亚洲等很多国家和地区的著名大学或研究机构担任客座教授等重要职务。著有《面板数据分析(Analysis of Panel Data)》，《经济计量模型、技术与应用(Econometric Models, techniques, and Applications)》等著作。萧政教授对中国数量经济学的引进与发展做出了巨大的贡献，早在1980年，即随同诺贝尔经济学奖获得者、美国宾夕法尼亚大学经济系克莱因教授，参加颐和园讲习班的授课工作，为改革开放的中国培养了第一批初步了解计量经济学的人才，该讲习班在中国数量经济学发展史乃至对中国经济学研究发展都是一个十分重要的事情。此后，萧政教授仍对中国的改革开放的发展，特别是计量经济学的发展给予了很大的关注，曾多次到华访问讲学，与中国学术界保持着密切而良好的关系，同时萧政教授更注重促进中美学术交流，为双方的交流沟通做出了大量无私的努力和贡献，其中对我院特别是数技经所的对外学术交流以及年轻学者的培养提供了尤为巨大的帮助。

此次讲座受到了国内数量经济学界的广泛重视和关注，许多京外研究单位和高校的学者学生也不辞天气炎热、路途遥远等困难，参加讲座。除来自我院有关院所的人员外，还有来自北京大学、东北财经大学、南开大学、西南财经大学、山东大学等十余所院校的学者学生，实际参加讲座的听众达到110人，远远超过了原来60人的预定规模，致使主办者将会议地点换到更大的会议室后，仍显得十分拥挤，场面十分热烈。讲座结束后，与会人员纷纷表示受益匪浅，即听到了高水平的专业授课，又了解了国外该学科的前沿，同时萧政教授的双语讲座也极大的提高了交流效果，希望今后仍能继续得到这样与世界一流学者直接和有效的交流机会。

(执笔：数技经所 韩胜军 张涛)

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561  
版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所  
联系我们 E-mail to: [iqte@cass.org.cn](mailto:iqte@cass.org.cn)