



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

□ 您的位置: 首页 → 主页内容 → 数技通讯

世界著名经济计量学专家访问我院

应我院邀请, 美国南加州大学经济系萧政教授 (Prof. Cheng Hsiao)、台湾“中央研究院”经济研究所所长管中闵教授 (Prof. Chung-Ming Kuan) 于2006年5月12日来大陆访问。两位教授在参加由中国数量经济学会在杭州举办的数量经济学会2006年年会后, 飞抵北京访问我院数技经所, 管中闵教授还访问了我院经济所和研究生院, 并在研究生院做演讲。

萧政教授是世界著名的经济计量学专家, 现任美国南加州大学经济系教授, 长期从事计量经济学研究与教学, 为 (Panel Data Analysis) 面板数据研究领域的权威学者。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。

此次萧政教授访问在会议上提交了一篇实证研究论文“吸食大麻去罪化及其对社会流行影响: 澳大利亚实证研究”, 对澳大利亚政府有关吸食大麻的政策在实际应用中的影响和结果进行了分析研究, 论文运用概率单位转换模型等得出结论, 即其政策 (即吸食大麻去罪化) 造成吸食增加的比率 (11%) 要远比一些先前乐观的研究高得多 (最高7%), 显示了经济计量研究对经济社会现象研究的实用性和重要性。

管中闵教授是台湾著名的经济学家, 在世界经济计量学界有一定的声望。现为台湾“中央研究院”院士、经济所所长, 并在台湾多家有关经济的机构兼职。主要研究领域为计量经济学、时间序列分析、应用金融等领域。其在杭州会议提交了有关长周期购买力平价的分析论文, 并在我院研究生院作了关于“分位数回归” (Quantile Regression, 台湾译为分量回归) 的演讲。分位数回归是计量经济学的研究前沿方向之一, 它利用解释变量的多个分位数 (例如四分位、十分位、百分位等) 来得到被解释变量的条件分布的相应的分位数方程。与传统的OLS只得到均值方程相比, 它可以更详细地描述变量的统计分布。管教授在介绍了分位数回归的概念、估计方法的基础上, 通过汽车保险理赔、劳工性别歧视、股市成交量与报酬率的关系等实证案例, 介绍了分位数回归的特点和优势。在互动讨论时间, 还就分位数回归的研究热点、适用性、样本要求、已有的软件工具等方面回答了听众的提问。

两位教授的来访不仅使大陆学者了解海外经济计量研究的前沿, 而且还对如何运用经济计量理论进行实证研究有了一定的了解, 特别是两位教授对演讲准备充分, 交流认真, 加上幽默风趣的言语, 使枯燥的理论探讨变得如讲故事般娓娓道来, 得到了与会者的热烈掌声。
(数技经所 韩胜军)

Search the Web

Find It