

《面板数据分析》

图书基本信息

书名：《面板数据分析》

13位ISBN编号：9787301092187

10位ISBN编号：7301092180

出版时间：2005-9

出版社：北京大学出版社

作者：萧政

页数：366

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介以及在线试读，请支持正版图书。

更多资源请访问：www.tushu000.com

《面板数据分析》

前言

应北京大学出版社之邀，为《经济学前沿影印丛书》写序。中国现代主流经济学的教育开始于十多年前，那时，随着我国改革开放的深入，一批在海外卓有成就的学者回到国内，他们的归来对中国经济学教育与国际接轨具有重要意义。此间，各高校相继成立了现代经济学教育和研究的中心，如武汉大学高级研究中心(当时叫做武汉大学经济科学高级研究中心)完全按照国际著名大学经济学与金融学系的模式培养学生，取得了巨大的成就，大量的学生被送到世界知名的大学攻读博士学位，这在以前是不可想像的。北京大学中国经济研究中心也在北京大学开办了双学位班，对本科生教育起了巨大的推动作用。通过这批海外归来的学者..

《面板数据分析》

内容概要

《面板数据分析》(第2版)是面板数据分析这一领域的经典之作,《面板数据分析》(第2版)系统地介绍了有关面板数据的基本理论,尤其是对面板数据在控制未观察到的个体或时间偏差,以避免设定误差,改善估计效率方面的应用;并且,《面板数据分析》(第2版)审慎地使用了实证研究的案例,这使得《面板数据分析》(第2版)对经济学、商学、社会学和政治科学的研究生和研究人员非常有用。在1986年第一版的成功基础上,《面板数据分析》(第2版)第二版对第一版进行了丰富的修改,以一种严谨易读的方式将有关面板数据研究的近期进展加入到书中,并且使这部分内容与原有的内容融为一体。第二版特别的修改包括:介绍了贝叶斯方法以及在广义矩方法框架下的估计量的严格外生性的概念,使得各种模型的识别联系起来;对估计离散选择模型的半参数方法提出了直觉解释;以及介绍了面板样本选择模型的估计的成对整理方法(methods of pairwise trimming)等。

《面板数据分析》

作者简介

萧政，是南加州大学经济学教授。本书的第1版已经成为经济学文献中有关面板数据的标准介绍。他还是《经济计量模型、技术与应用》一书的合作者，并与他人共同主编了《面板模型和受限因变量模型分析》及《非线性统计推断》等著作。他是计量经济学会的成员以及《计量经济学杂志》

《面板数据分析》

书籍目录

Preface to the Second Edition Preface to the First Edition Chapter 1 Introduction 1.1 Advantages of Panel Data 1.2 Issues Involved in Utilizing Panel Data 1.3 Out of the Monograph Chapter 2 Analysis of Covariance 2.1 Introduction 2.2 Analysis of Covariance 2.3 An Example Chapter 3 Simple Regression with Variable Intercepts 3.1 Introduce 3.2 Fixed-Effects Models: Least-Squares Dummy-Variable 3.3 Random-Effects Models: Estimation of Variance-Components Models 3.4 Fixed Effects or Random Effects 3.5 Tests for Misspecification 3.6 Model with Specific Variables and Both Individual and Time-Specific Effects 3.7 Heteroscedasticity 3.8 Models with Serially Correlated Errors 3.9 Models with Arbitrary Error Structure - Chamberlain Approach Chapter 4 Dynamic Models with Variable Intercepts 4.1 Introduce 4.2 The Covariance Estimator 4.3 Random-Effects Models 4.4 An Example 4.5 Fixed-Effects Models 4.6 Estimation of Dynamic Models with Arbitrary Correlations in the Residuals 4.7 Fixed-Effects Vector Autoregressive Models Chapter 5 Simultaneous-Equations Models Chapter 6 Variable-Coefficient Models Chapter 7 Discrete Data Chapter 8 Truncated and Censored Data Chapter 9 Incomplete Panel Data Chapter 10 Miscellaneous Topics Chapter 11 A Summary View Notes References Author Index Subject Index

《面板数据分析》

媒体关注与评论

“迄今为止关于Panel Data模型的最全面、系统、深入的教科书……该书的出版，无疑是填补国内现代计量经济学教科书的一个空白。” ——清华大学经济管理学院教授 李子奈

《面板数据分析》

编辑推荐

《面板数据分析》(第2版)“迄今为止关于Panel Data模型的最全面、系统、深入的教科书……该书的出版，无疑是填补国内现代计量经济学教科书的一个空白。”

——清华大学经济管理学院教授 李子奈 同名英文原版书火热销售中：Analysis of Panel Data

《面板数据分析》

精彩短评

- 1、经典，无须多言
- 2、这是一本好书，终于弄到手了。
- 3、到目前为止介绍面板数据的书很少，国内的书没有较好的，这本书深入浅出，把原理介绍的很清楚，也比较容易理解，看了几章到目前，觉得很值得，可以结合一些现实问题来做出自己的判断。所以对于研究中国的一些问题特别缺少数据类的经济问题有很大帮助！
- 4、书挺好的，不过还是建议有兴趣的同学们去看原版的montecarlo
- 5、萧政老头子作为面板数据分析的创始人，这本书当然是无可置疑的经典。对于想要入门并且了解面板数据分析发展历史的读者，这本书显然值得一读。
- 6、经典，计量经济学的经典
- 7、作者是很严谨的学者，但这样的作品，想短期掌握是很困难的。因为在stata里提供了不少面板数据的算法，当时就用别的书学习应用了，模型变来变去，还是想轻松的算出结果，并解释清楚，可以先看看Greene的书，后看本书，进度会快一些。
- 8、适合做研究用 写的不错
- 9、萧老爷子的学术水平毋庸置疑，书也写的好，兼学英文，很不错的书呢
- 10、肖先生是我老师的老师，经典之作，我们的教材
- 11、面板数据分析一书，是当今世界权威的教科书，作者萧政教授是这个领域的权威，我现在还看不懂呵呵，听过萧政教授的课，但是听不懂，或者没用心听。
- 12、Hsiao很经典的书，不可不看
- 13、肖政是面板数据的国际大师级人物，为了讲课，我观摩了本书的一半左右内容，觉得借书不过瘾，遂在dangdang弄了一本，这本书经典当然是经典，但适合有一定高级计量经济学基础的人学习，至少你得对矩阵表达很亲切才行，同时对经典结论，方法已经有一定的熟悉程度，比如横截面回归中的异方差，时间序列分析中的单位根，协整理论等。个人觉得如果参考其他简单一点的比如Badi Baltagi的看效果会更好。
- 14、此书系全英文，不太好用
- 15、我还以为是翻译成中文的
- 16、去厦大听听这些大师的内容受益匪浅。这个书是经典。唯一不好地方就是太贵，基本不打折。萧政介绍说，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。他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。好好学习吧！
- 17、等有空再看喽

《面板数据分析》

精彩书评

1、这本书可以说是面板数据领域最权威的教材，试看国内所发表的关于面板数据的论文，绝大部分都是用本书的理论去做实证，而且思路、过程等均照搬本书。可惜本书有一定的难度，国内文章一般都只用到本书前三章的内容，对于后面动态面板、变系数面板等，大部分人都看不懂，也不会用

。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:www.tushu000.com