



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 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

## Markov区制转移模型与我国通货膨胀波动路径的动态特征

(摘要) 本文应用Markov区制转移模型, 对我国1984年以来通货膨胀率的动态路径进行了模拟分析。估计和检验发现了我国通货膨胀路径中不仅存在高通胀区制和低通胀区制, 也存在经济政策机制与通货膨胀率区制之间的相关性。通过与传统的自回归模型相比较Markov区制转移模型考虑了通货膨胀率的内生转移机制, 从而更好地拟合和刻画了通货膨胀率的数据生成过程。

关键词 Mark. v区制转移模型 通货膨胀率 平滑概率

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