

[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机制转换模型研究——在中国宏观经济周期分析中的应用

**【摘要】** 本文首次引入反映我国经济增长周期模式改变和状态转移机制变迁的虚拟变量，对传统Markov机制转换模型进行了修正，由此解决了将Markov模型应用于中国年度宏观经济数据研究中国经济周期问题的难题。运用修正后的Markov模型，本文对我国1953-2005年的年度实际产出增长率的数据进行了拟合，研究表明，该模型较好地刻画了我国实际产出增长的周期性变化。根据分析我们发现，改革前后我国经济周期的非对称性特征比较明显，并且经济增长周期模式和经济周期性变化机制存在显著差异。

关键词 Markov模型 状态转换 经济周期

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)