



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

中国宏观经济统计数据异常性和波动性特征的计量检验：1953~2001

【摘要】对于宏观经济统计数据的异常性和波动性进行分析，已成为研究数据质量的最核心内容之一。本文从经济系统的角度运用随机方差扩大模型对我国36个宏观经济时间序列的数据质量进行了全面分析，发现了数据异常及波动的特点和规律。研究结论表明，大部分异常点的出现或多或少都是以聚集成堆的形式出现，它们之间有深刻的内在联系，异常点的出现大多与各种历史因素以及外部冲击有关；几乎所有的原始序列都有显著的偏度，过多的峰度也是明显的，因此它们被显著地拒绝认为服从正态分布；名义序列的特征在更大程度上受到异常点的影响。

关键词 统计数据 异常点 宏观经济 随机方差扩大模型