



- 首页
- 关于我们
  - 分类
  - 学院简介
  - 院长致词
  - 学术机构
  - 学术顾问委员会
  - 教学支持平台
  - 计量经济学研究中心
  - 金融研究中心
  - 中国劳动经济学与社会
  - 现代统计学研究中心
  - 中国宏观经济与金融研
  - 政治经济学研究中心
  - SAS计量经济学合作中
  - 发表文章
  - 院长办公室
  - 高性能计算与数据中心
  - 图书资料室
  - 高级培训与咨询中心
- 学院人员
  - 博士后人员
- 人才培养
  - 专业介绍
    - 劳动经济学
    - 统计学
    - 西方经济学
    - 金融学
    - 数量经济学
  - 课程介绍
  - 博士后流动站
  - 博士研究生
    - 06级博士生
    - 07级博士生
    - 08级博士生
    - 09级博士生
    - 10级博士生
  - 硕士研究生
    - 05级硕士生
    - 06级硕士生
    - 07级硕士生
    - 08级硕士生
    - 09级硕士生
    - 10级硕士生
  - 本科双学位
  - 留学生
    - 08级留学生
- 学生就业
  - 2008届毕业生
  - 2009届毕业生
  - 2010届毕业生
- 学术研究
  - 工作论文
  - 发表文章
  - 研究项目
- 讲座系列
  - 本学期讲座日程表
  - IZA劳动经济学讲座
    - 本学期
    - 2009秋季
    - 2009春季
    - 2008秋季



首页 - 资源库

## 空间误差模型的稳健检验

作者：张进峰，方颖 编号：20101027 被浏览：1288次

本文即将在《数量经济技术经济研究》发表。

摘要： 本文构建了一个用来检验空间误差模型的稳健统计量，它以Bera 和 Yoon(1993)的理论为基础，渐进具有 检验统计量的良好大样本性质。这种检验方法不仅可以有效减少空间滞后效应对统计推断的影响，而且在很大程度上简化了计算。作为比较，我们发现当真实模型中存在显著的空间滞后效应时，Anselin et al(1996)提出的检验统计量会产生明显的偏误而我们的检验统计量依然有效。蒙特卡罗模拟的结果与本文的预期一致。

关键词： 空间误差模型 极大似然估计 稳健检验

[点击进入下载](#)

上一条: A Panel Data Approach 下一条: 中国产出缺口的实时估

### 联系方式:

通讯地址: 厦门大学王亚南经济研究院经济楼A308

邮政编码: 361005

联系电话: 86-592-2188827

传 真: 86-592-2187708

电子邮件: wise@xmu.edu.cn

- 2008春季
- 2007秋季
- 高级经济学讲座
  - 本学期
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
  - 2008春季
  - 2007秋季
  - 2007春季
  - 2006
  - 2005
- 青年学者论坛
  - 本学期
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
  - 2008春季
  - 2007秋季
  - 2007春季
- 职业发展讲座
  - 2011春季
  - 2010秋季
  - 2010春季
  - 2009秋季
  - 2009春季
  - 2008秋季
- 午餐学术讲座
- SMU-MAF讲座
  - 本学期
  - 2008秋季
  - 2008春季
- 会议活动
  - 即将举办
  - 已经举办
    - 2010
    - 2009
    - 2008
    - 2007
    - 2006
    - 2005
- 资源库
  - 学生事务表单下载
  - 学术研究网
  - 教学支撑平台
  - 讲座资源平台
  - 教务管理平台
  - 科研管理平台
  - 协同办公平台
  - WISE论坛
  - WISE考研网
  - WISE院刊
  - 厦门风光
- 校企合作
- 人文地理
  - 厦大风光
  - 厦门风光
  - 武夷山
  - 泉州（开元寺、市区、闽台博物馆）
  - 湄洲湾（妈祖庙）
  - 客家土楼
  - 古田会议