



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

□ 您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

多种单位根检验法的比较研究

【摘要】 本文基于单位根检验基本原理，比较了5种单位根检验的方法，说明在小样本情况下，为提高检验功效，应针对数据生成过程的特点联合多种检验法进行检验。如果检验变量为非平稳，则需要进行进一步的结构突变检验，本文主张选用结构突变点内生的Perron检验法与外生检验法相结合来判断变量的平稳性。

关键词 K PSS检验 DF-GLS检验 NP检验 结构突变

Search the Web

Find It

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