



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

退势单位根检验小样本性质的比较

[摘要]在经验研究中, 尽管Dickey—Fuller检验的DF统计量是应用最广泛的单位根检验, 但是, 它的检验功效偏低是众所周知的。为了改善Dickey—Fuller检验的功效, 本文将时间序列的退势和DF检验、WS检验、MAX检验和RMA检验相结合, 通过蒙特卡洛模拟试验研究了20种单位根检验的小样本性质, 研究发现, 对时间序列的退势(demeaning / detrending)均能不同程度地改善单位根检验的功效; 时间序列的递归退势RMA检验(RMA-ROLS检验)具有最理想的小样本性质, 它的检验功效高于其他检验, 其次是基于GLS退势的DF检验(DF-GLS检验)。

关键词 退势单位根检验 小样本性质 蒙特卡洛模拟