



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

基于DIC准则的ASV 模型和SV模型的实证比较

【摘要】 本文将标准的SV模型转化为状态空间模型，受混合状态空间模型要优于一般的状态空间模型这一结论的启发，将标准的SV模型做了两个方面的扩展，一是在原模型中加入确定性的部分，二是将模型中状态变量由AR(1)拓展到GARCH(1,1)来刻画，从而得到五个扩展模型，通过MCMC方法得到各个模型参数估计值及DIC值，并以此来评价各个模型的优劣。本文得出以下结论：(1)用GARCH(1,1)来刻画状态变量的变化过程要优于用AR(1)；(2)加入适当的确定性部分并放在正确的位置能够提高模型的拟合优度。

关键词 SV模型 ASV模型 MCMC DIC准则 状态空间模型

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