

[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

非线性时间序列分析STAR模型及其在经济学中的应用

【摘要】20世纪90年代末以来,非线性时间序列模型两个主要的研究方向是混沌论模型(chaos model)和机制转换模型(switching regime models),而后者考虑了各种不同形式的机制转换行为(switching regime behavior),通常被认为由三个最常见的机制转换模型组成^①。平滑转换自回归模型(STAR)由于能在某种程度上捕捉到机制转换过程中时间序列的动态过程,因而成为近年国外计量经济学前沿领域追踪的热点之一。本文将主要对平滑转换自回归模型(STAR)的特征、估计、检验方法以及在经济领域的应用做深入的探讨。

关键词 非线性 STAR LSTAR ESTAR