

[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

□ 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

同期相关面板数据退势单位根检验的小样本性质

【摘要】 本文基于SUR回归将时间序列的两种单位根检验(ADF—GLS检验)推广到面板数据,得到了同期相关面板数据退势单位根检验,称为SUR—ADF—GLS检验。通过蒙特卡洛试验研究发现,SUR—ADF—GLS检验具有良好的小样本性质。并且,SUR—ADF—GLS检验关于面板数据的同期相关性结构存在着较强的“依存性”。

关键词 面板单位根检验 SUR—ADF—GLS检验 小样本性质 蒙特卡洛模拟

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