



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

## DF检验式中联合检验F统计量分布特征

**【摘要】**单位根检验同被检验的模型中是否存在常数项、时间趋势项密切相关,针对常数项和时间趋势项及其t统计量的分布特征目前得到了很好的研究,但是相厘的联合检验F统计量研究很少,而Hatanka(1996)就提到了该统计量的重要性,并认为有必要对其分布特征进行研究。本文通过蒙特卡罗模拟,分析了DF检验式中联合检验F统计量的分布特征,在此基础上给出了有限样本条件下各检验统计量的响应面函数,从而使得单位根检验进一步完善。

关键词单位根检验 F统计量 蒙特卡罗模拟 响应面函数

Search the Web

Find It