

基于广义非线性工具变量法的综列单位根检验

杨继生,王少平

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 当截面个体之间显著相关时,非线性工具变量法(NIV)综列单位根检验存在严重的分布扭曲.该文基于似无关回归形式的可行广义最小二乘法和非线性工具变量估计方法,提出了广义非线性工具变量法(GNIV)综列单位根检验,以修正NIV检验的分布扭曲.在存在综列单位根的原假设下,GNIV检验统计量的极限分布为标准正态分布,而在备选假设下则趋向于负无穷大.仿真实验结果显示,在截面个体之间显著相关时,GNIV检验的有限样本性质显著优于Chang的NIV检验和Pesaran的CIPS检验.

关键词 [综列单位根检验](#) [非线性工具变量](#) [可行广义最小二乘法](#) [截面相关](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009040111](#)

通讯作者:

作者个人主页: [杨继生](#); [王少平](#)

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (451KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (0KB)

▶ [参考文献\[PDF\]](#)

▶ [参考文献](#)

服务与反馈

▶ [把本文推荐给朋友](#)

▶ [加入我的书架](#)

▶ [加入引用管理器](#)

▶ [引用本文](#)

▶ [Email Alert](#)

相关信息

▶ [本刊中 包含“综列单位根检验”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [杨继生](#)

· [王少平](#)