



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

## 汇率波动率与中国对主要贸易伙伴的出口

**提要：**本文研究汇率波动率对中国向三个主要贸易伙伴：美国、欧盟和日本出口的影响。汇率波动率使用汇率对数收益率的标准差来度量。通过协整检验，误差修正模型和Granger非因果检验等方法估计变量间长短期的关系。研究表明中国向美国和欧盟的实际出口与实际汇率波动率存在长期显著的负相关关系，而中国向日本的出口与汇率波动率无关。短期内汇率波动率只影响中国向美国的出口，对向欧盟和日本的出口没有影响。建议管理当局针对人民币对不同贸易伙伴的汇率设定不同的波动幅度，关注汇率波动率增加对出口产生的影响。

**关键词：**汇率波动率；出口；协整；误差修正模型；Granger非因果检验

Search the Web

Find It