

# 基于随机方差扩大模型的对中国宏观经济统计数据的结构变化分析

周建  
上海财经大学经济学院, 上海, 200433

## The Analyses on Structure Changes in Chinese Macroeconomics Data Series based on RVAR Model

ZHOU Jian  
School of Economics, SHUFE, Shanghai 200433, China

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

Download: PDF (KB) [HTML](#) (KB) Export: BibTeX or EndNote (RIS) Supporting Info

**摘要** 本文从经济系统的角度运用随机方差扩大模型对我国36个宏观经济时间序列趋势成分的结构变化特征进行了全面的分析,发现了数据结构变化的特点和规律. 研究结论表明:趋势成分和序列本身具有类似的结构变化特征,但是结构变化的范围、幅度却存在显著性差异;我国宏观经济统计数据结构变化的主要特征受到相应序列的趋势成分、波动成分的组合方式及其构成比例的深刻影响;大部分结构变化点的出现或多或少都是以聚集成堆的形式出现的,它们之间存在深刻的内在联系,结构变化点的出现大多数与各种历史因素以及外部冲击有关;大部分发生结构变化原始序列与其趋势成分的波动性特征出现了显著差异,而结构变化点修正后序列及其趋势成分的波动幅度与范围极其相似.

**关键词:** 统计数据 结构变化 趋势成分 H-P滤波 随机方差扩大模型

**Abstract:** This paper uses RVAR model to deeply analyze 36 Chinese macroeconomics data series from the view of economic system and finds out the features and rules of the structure changes. The results show: The trend components and the primitive series have the same features of structure changes, but there exist obvious differences between them on the ranges and scopes. The structure changes of Chinese macroeconomics data are mostly affected by the compounding way and the constitutive proportion of the trend components and the volatility components. The most of structure changes appear in the cluster form more or less, and there are deep internal relationship between them, and the structure changes are mostly caused by the historic factors and external shocks. Almost all of the original series and the trend components have different volatility features in the structure changes, but corrected series and the trend components are the most similar features.

收稿日期: 2005-01-18;

基金资助: 教育部2005年度人文社会科学规划项目(05JC790104); 教育部人文社会科学重点研究基地重大项目(01JAZJD790004); 上海财经大学“211工程”重点学科建设项目和上海财经大学新进博士科研启动项目资助

引用本文:  
周建 . 基于随机方差扩大模型的对中国宏观经济统计数据的结构变化分析[J] 中国管理科学, 2006, V(3): 128-134

Service	
把本文推荐给朋友	
加入我的书架	
加入引用管理器	
Email Alert	
RSS	
作者相关文章	
周建	

没有本文参考文献

没有找到本文相关文章