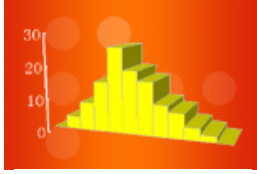


# 统计学

[在线教程](#) | [案例与参考资料](#) | [模拟试卷](#) | [教学录像](#) | [相关网站](#) | [在线题库](#)



● 案例与参考资料

## 案例与参考资料

- 第一章 绪论
  - 曾五一：关于经济
  - 曾五一：关于经济
  - 陈希孺：关于我国
  - 贾洪卫：计算机与
  - 曾五一：关于进一
- 第二章 统计资料的搜集
  - 朱建平：《大学生
  - 李露华：建立国家
  - 郑京平：中国国家
  - 李强：加强普查与
  - 汤以伦：必须坚持
- 第三章 统计描述
  - 徐明生：关于平均
  - 朱建平：山西省晋
- 第四章 抽样分布与参数估计
  - 黄长全：用一例典
  - 黄长全：趣味小案
  - 国家统计局：2005
  - 周晓燕：高学历青
- 第五章 假设检验
  - 朱平辉：能从高尔
  - 朱平辉：我国经济
  - 朱平辉：统计检验
- 第六章 方差分析
  - 朱平辉：“地域”
  - 朱平辉：统计大家
  - 朱建平：正交试验
- 第七章 相关与回归分析
  - 袁卫：“回归”一

## 我国经济增长的风险分析

朱平辉 林东阳

新中国成立后，社会主义经济建设经历了三个不同特点的发展阶段。1953年制定和实施第一个“五年计划”，标志着社会主义经济建设的开始；1978年十一届三中全会召开后，我国依次进行了农村和城市的经济体制改革探索，实行有计划的商品经济运行模式；1992年后，以小平同志南巡讲话和“十四大”召开为标志，我国进入建设社会主义市场经济体制阶段。解放后我国经济建设取得了巨大的成就，特别是实行改革开放政策以来，中国经济的发展速度举世瞩目，经济增长抵御风险的能力也显著增强。根据我国经济增长的实际，如何测算我国经济增长的风险及其产业构成，分析宏观经济抵御风险能力的变化趋势呢？

### 一、风险的VAR测算方法

1、风险的测量。风险的测算就是量化风险的大小，包括两方面任务：一是对风险因素进行综合评价，二是在分析的基础上拟定一个基本的风险标准，以此衡量风险的临界值。风险测算方法分为主观测算法与客观测算法，但这里的主、客观不是一个绝对的概念，指的是有关测算方法，其有效性依赖于主观因素多一些还是客观因素多一些。主观风险测算方法简便易行，不足之处是有赖于风险管理者的个人经验与判断能力；客观测算法将风险的测量建立在数据分析的基础上，能更有效地避免风险管理者个人因素的过多影响。VAR方法是一种客观风险测算方法。

在菲利普·乔瑞的经典著作中，VAR被定义为“给定的置信水平和目标时段下预期的最大损失（或最坏情况下的损失）”。从定义可知，与VAR相关的两个重要参数是置信水平和目标时段。目标时段就是收集每项数据的时间长短，简称测算的时间跨度。“置