

ECONOMIC REVIEW

A Core Journal in China
A Core Journal in Humanities and Social Sciences in China
A Journal Indexed in the CSSCI
A Top Journal in Economics in China
A Journal Financially Supported by the National Social Science Foundation of China

ECONOMIC REVIEW

经济评论

ECONOMIC REVIEW

全国中文核心期刊 • 全国人文社会科学核心期刊 • CSSCI来源期刊
全国优秀经济期刊 • 国家社会科学基金资助期刊

- **Xiao Ting**
Whether the Environmental Quality Is the Leading Factor of Labor Mobility?
- **Xie Ronghui and Yuan Yijun**
Research on the Pollution Abatement Effect of Industrial Agglomeration's Evolution
- **Jiang Qi**
Quality of Government, Cultural Traditions and Regional Economic Development: Based on the Perspective of Both Quantity and Quality
- **He Lingxiao, Nan Yongqing and Zhang Zhonggen**
Aging, Social Network and Household's Farming: Evidence from CFPS
- **Lv Daguo, Shen Kunrong and Jian Ze**
Retest of Learning-by-exporting Effect: An Empirical Analysis Based on Trade Type

Vol.198 No.2 2016
Wuhan University



Price: 15.00 CNY

经济评论 (总) 第一九八期 二〇一六年第二期

- **肖 挺**
环境质量是劳动人口流动的主导因素吗? ——“逃离北上广”现象的一种解读
- **谢荣辉 原毅军**
产业集聚动态演化的污染减排效应研究——基于中国地级市面板数据的实证检验
- **姜 琪**
政府质量、文化资本与地区经济发展——基于数量和质量双重视角的考察
- **何凌霄 南永清 张忠根**
老龄化、社会网络与家庭农业经营——来自CFPS的证据
- **吕大国 沈坤荣 简 泽**
“出口学习效应”的再检验: 基于贸易类型的实证分析

2 2016 武汉大学主办



主 管：中华人民共和国教育部
主 办：武汉大学
出 版：武汉大学经济评论杂志社

社 长：徐业勤
副社长：李继龙

主 编：叶初升
副主编：罗 琦
编辑部主任：陈永清

地 址：武汉市武昌珞珈山
邮 编：430072
电 话：027-68754563
027-68753012
网 站：http://jer.whu.edu.cn
E-mail: whujer@163.com
jer@whu.edu.cn
国际刊号：ISSN 1005-3425
国内刊号：CN42-1348/F
发行范围：国内外公开发行
国内发行代号：38-204
国外发行代号：BM4486
国内总发行：武汉市邮政发行局
国外总发行：中国国际图书贸易公司
(北京市399信箱)

刊名题字：谭仁杰
封面设计：龙御尚品文化传媒
印 刷：武汉中科兴业印务有限公司
出版日期：2016年3月15日
本期责任编辑：彭 爽 陈永清
技术编辑：李 晨

学 术 委 员 会

名誉主任：谭崇台
主 任：谢丹阳
委 员：（以汉语拼音为序）
白重恩 清华大学
蔡洪滨 北京大学
陈勇民 University of Colorado Boulder
甘 犁 Texas A&M University
西南财经大学
龚六堂 北京大学
洪永淼 Cornell University
厦门大学
黄晓东 Vanderbilt University
陆 铭 上海交通大学
复旦大学
罗雨雷 香港大学
钱颖一 清华大学
沈坤荣 南京大学
孙一啸 University of California, San Diego
武汉大学
田国强 Texas A&M University
上海财经大学
涂 俊 Singapore Management University
王 城 复旦大学
Iowa State University
王 诚 中国社会科学院
王 平 Washington University in St. Louis
王苏生 香港科技大学
谢丹阳 武汉大学
香港科技大学
杨瑞龙 中国人民大学
袁志刚 复旦大学
张 军 复旦大学
赵耀辉 北京大学
周 林 上海交通大学
朱晓冬 University of Toronto
邹恒甫 武汉大学

《平滑转移协整模型的理论分析与应用》书评

（武汉大学经济与管理学院 曾国安）

经济学诸多理论和模型必须经过实证检验，才能对其正确性和有用性作出判断，这就决定了自它们被提出开始，就要经历大量的修改和完善。不断变化的经济环境和新的影响因素的发现，都会对现有理论提出挑战。在这一破一立之间，往往孕育着新的理论发展。在理论与模型建立过程中，经济变量的筛选，进而建模方法的选取，以及代表变量之间关系的模型结构优化问题，一直是经济学者攻坚的难点。具体到经济学中的时间序列分析问题上，离散化状态依赖与平滑转移机制的优劣比较，经济变量组合之间协整关系的线性与非线性问题探究与模型实现，已经是近年来经济计量研究领域的热点问题。计量模型分析必须依赖于经济理论，而时间序列分析对于理论检验的非一致性与交互问题，也值得深入研究。方臻旻博士的学术专著《平滑转移协整模型的理论分析与应用》（华中科技大学出版社2014年出版）对此展开了深入研究。该书着力于理论，并应用理论进行实证研究，主次分明，层层深入，对这些问题逐一进行了讨论并给出了自己的解答，同时基于现有理论进行创新，提出了极具理论和应用价值的平滑转移协整模型，实属难能可贵。

该书首先梳理了非线性模型的建模理论与协整理论的发展历程和研究现状，从经济学分析变量的非平稳性入手，指出经典线性模型在对包含结构突变和机制转换的经济变量关系的模拟上存在的缺陷与不足，充分肯定了平滑转移机制在解决这类问题上的优越性。随后，对现行的标准协整理论进行深度剖析，在汲取其理论精华的基础上，指出标准线性协整理论存在所要求的假设前提过于苛刻而难以满足的问题。基于以上这些分析，可以认为将平滑转移回归（STR）与非线性协整结合，建立一个同时考虑平滑机制转移和数据非平稳过程的模型，对于实证分析是具有相当重要意义的，它将会成为非线性时间序列分析理论发展的一个重要突破口。可以说，该书所构建的平滑转移协整模型为这一领域的发展做出了开创性的贡献。

实证研究的一大难点，就在于理论内容的弹性带来的模型的非确定性问题。有些理论发展至今并不完善，可选变量和模型多，使得学者们在模型构建上往往莫衷一是，该书论及的城乡二元化问题所涉及的模型就是例证。在传统计量经济学的学习中，十分强调计量模型的构建必须基于经济学理论，坚持的是一种理论先导的建模方法，而这种方法的一大弊端，就是忽略了理论构建过程中自身潜在的主观性和因可选非排他性模型过多而带来的模糊性问题。虽然统计学家广泛采用数据先导方法，但又因此难以避免数字游戏和伪回归。经济理论先导和数据先导这两种方法存在的一个共性问题，就是建模思想引导的单向性，缺乏模型与数据之间的反馈与交互机制。为了解决这一问题，作者在书中倡导使用Hendry的动态建模理论。具体而言，就是首先建立代表数据生成过程（DGP）的自回归分布滞后（ADL）模型，然后逐步回归并简化，以剔除不显著变量，最终得到仅包含变量间长期稳定关系的约化模型。在实证研究部分，作者基于动态建模思想，参照基本理论和已有文献，初步确立所有可能变量，随后通过显著性检验和格兰杰因果检验对变量进行了甄别和锁定，最终完成建模。应该说，作者的研究为解决目前存在的经济理论先导和数据先导这两种方法的缺陷提供了一个新的有益的思路和方法，颇有启发性。

该书还详细阐述了机制转移位置参数的确定，模型线性对非线性的检验，机制转移函数具体形式的选取，模型估计中高斯-牛顿方法、模拟退火法，以及JMulTi软件的应用。内容丰富，见解深刻，具有较高的学术价值和前瞻性。

此外，该书所做的实证分析既是对作者所提出的理论的验证，所得出的研究结论以及根据研究结论所提出的政策建议也具有现实参考价值。

总的来看，该书是该领域理论研究和应用研究的一项重要的创新性成果，其问世必将推动该领域理论研究和应用研究的进一步发展。

