



学术论文

《数量经济技术经济研究》2006年第1期

[\[PDF全文下载\]](#)

格兰杰因果性检验评述

世界经济统计分析研究室 曹永福

[内容摘要] 格兰杰因果性检验是计量经济学中最常用的因果性检验方法，但是因为种种原因，目前存在着对该检验方法的模糊认识 and 不正确运用。本文回顾了格兰杰因果性检验的发展过程，

并从信息集、非平稳变量、即期因果性等方面对运用格兰杰因果性时存在的一些问题进行了讨论。

[关键词] 因果性 格兰杰因果性 信息集

[JEL分类] C0、C3、C4

1. 引言

探讨因果性是科学研究的重要使命，我们的日常生活也几乎离不开“因果”，但是到底什么叫“因果性”，从哲学上并没有一个普遍接受的概念。伽利略认为原因是结果的充分必要条件，休谟主张因果律是一种“恒常的联系（constant conjunction）”，而后来Hart 和Honore 则主张“原因是导致结果发生变动的一种变动”。因果性的概念可谓众说纷纭，哲学家们直到今天仍然在为建立更合理的因果性概念而不断努力。

与哲学家的纯粹逻辑思辨不同，经济学中的因果性必须是可以通过实际的数据进行检验的。一般来讲经济学中的因果性概念与其具体的检验方法是统一的，其中最有影响力的是格兰杰因果性。但是因为缺乏对原始文献的准确把握，目前对格兰杰因果性存在一些模糊认识，这个问题已经引起部分学者的注意，如庞皓、陈述云（1999），周建、李子奈（2004）等等。但是，从实际情况看，格兰杰因果性仍然存在很多不恰当的应用。

为了更清楚的认识格兰杰因果性的全貌，本文首先简要介绍了因果性定义的概率论方法，然后全面介绍了格兰杰因果性的由来以及操作方法，并且从信息集、变量非平稳性、即期因果性等方面对国内目前实证研究中存在的问题进行了探讨。

.....

[推荐好友](#)

相关文章

曹永福 美国经济周期稳定化研究述评 《经济研究》2007年第7期 (2007-8-19)

本站的署名文章均属作者本人的观点。希望转载时，请事先与我们联系。

[院首页](#)[网站声明](#)[会员登录](#)[联系我们](#)[下载中心](#)[院图书馆](#)

地址:北京建国门内大街5号 邮编:100732 电话:010-85196063 传真:010-65126180 联系本站

《中华人民共和国电信与信息服务业务经营许可证》编号:京ICP备06059776号