

我表達與主體性建立的問題等等。此數篇論文雖各專彈詞小說問題之一面，但背後其實有一整體考慮的支撐。蓋彈詞小說個別作者的創作精神、讀者的接受心態、政經社會的外緣影響、文學潮流與文類本身的內在發展、創作者與文學傳統之間的張力、以及讀者接受的美感要求等等因素，在在使得彈詞小說在清代呈現多樣的面貌，其中的每一個層面都值得專文探討，而唯有從個別問題出發，再輔以宏觀視野，才能逐步探索此文類的面目以及其在文學史上的重要性。在時代發展上，筆者的研究也由清中葉跨越到晚清，並及當時的小說理論，在文類內部的發展之外，同時考慮歷史文化的脈絡，從而求得更有啟發意義的詮釋。



胡曉真

學經歷：

國立臺灣大學外文系
學士(1986)

美國加州大學聖地牙

哥校區比較文學碩士(1988)

美國哈佛大學東亞語言與文明系博士(1994)

中央研究院中國文哲研究所助研究員(1995- 迄今)

總體經濟時間數列間之 恆定性與結構性變動

郭炳伸

國立政治大學國貿系副教授

總體經濟時間數列多具有非恆定性質。恆定性質存在與否，關連著不同經濟理論的隱

涵。以備受爭議與討論的國民所得數列而言，若該數列具有恆定性質，則意味著造成該數列的衝擊(shock)只是短暫的，會隨時間而消弭於體系。反之，若驗證該數列為非恆定，則表示外來的衝擊對所得具有恆久性的影響，因而實質景氣循環(real business cycle)學派將可主張技術變動是經濟波動主要來源的重要證據。又若以實質匯率而論，該數列若呈恆定，代表著「購買力平價理論」獲得支持。該理論係許多國際金融模型的基本假設，或可視為長期均衡條件。數列的恆定性質與否，尚攸關經濟預測的準確性。若再以實質匯率為例，恆定性質的存在亦代表該數列具有可預測性，因為該數列終將回歸其長期均衡值。但若不具恆定性質，長期預測該數列不具任何意義。凡此種種，引發晚近總體計量技術與理論的快速發展，而應用新的計量工具獲致的實證結果，連帶地也影響新的經濟理論發展。總體經濟理論與統計計量的相互激盪與提升，似乎罕見於過去任何一個時期。

檢定總體變數時間數列的恆定性，是總體計量理論與技術發展的焦點。傳統的檢定量多以「非恆定」虛無假設為出發點。但以「恆定」為虛無假設所發展出的檢定量，則似乎更符合古典統計推論精神。惟屬後者的現有檢定量，概都以Lagrange原則建構而成。至今以概似此建構而成的檢定量仍付之闕如。其理由在於，發展該概似比檢定量所需要的基本極限性質，由於其不屬於標準問題，一般理論未能適用，因而仍未被證明建立。但概似比檢定的優越檢力性質，使得建立這些極限性質成為必要。研究之一，即是在建立與推導這些極限性質，為建立以「恆定」為虛無假設的概似比檢定鋪路。這些性質包括，概似函數極大值的一

致性與其漸近分配。這些理論結果亦具體化於模擬實驗中，我們發現大樣本近似頗為良好。

另一研究，則同時應用既有的以「恆定」或「非恆定」為虛無假設的檢定量於實質匯率。這部分的原始研究動機在於，同時採用兩種檢定量，可充分應用數列的情報，以避免誤判實質匯率恆定性質。如何充分利用數列中的情報？我們就美元／英鎊的實質匯率數列分別配適最佳「恆定」與「非恆定」迴歸式，並據此以為資料形成過程，產生模擬資料。之後，則就該些模擬資料計算不同檢定量的小樣本虛無與對立假設分配，用以判斷樣本統計量究竟來自恆定或非恆定分配。由於所採用的檢定量包涵以「恆定」與「非恆定」為虛無假設，將可使推論更具穩當性。這是因為若推翻「非恆定」虛無假說不一定代表實質匯率數列具有恆定性質；但又若「恆定」虛無假說受到支持，則可進一步確認實質匯率具有恆定性質。我們的研究發現實質匯率應具有恆定性質，亦即「購買力平價」的確存在，而與最近的實證發現相符。

非恆定數列間線性關係的估計與檢定課題，則是晚近時間序列研究的另一個焦點。該線性關係，或稱「共積」的重要性，在於其能夠描繪總體經濟變數間的長期均衡，而使得僅存在於理論討論的概念，得以接受實際資料考驗。正如同一般數列間的線性關係，「共積」現象也可能因政策變動而產生結構性變動。因此發展檢定或估計該結構性變動的計量理論與技術，則屬必要。

另一研究，即專注於建構用於前述「共積」關係的結構性變動檢定。惟該研究的討論重點，偏重於檢測「部分」參數的結構變動，如同古典t檢定。我們分別就結構性變動的屬

性，急遽抑或漸進，提出三種檢定量。這三種檢定量，在一般恆定迴歸文獻早有討論與使用，且多具有最適檢力性質。但應用於檢測非恆定資料中「部分」參數的結構性變動，則未多見。該研究的主要貢獻在於，推導不同模型下三檢定量的極限分配，並模擬其小樣本表現。後者的結果十分有趣。我們發現，若「部分」共積參數發生結構變動，「部分」參數檢定量會比「全部」參數檢定量更具有檢力偵測出該結構變動。這些檢定量因此具有相當廣泛的實用性。我們進一步利用這些檢定量於美國貨幣需求函數的結構性變動偵測，是前述應用性的最佳佐證。

非恆定數列的計量理論仍在持續發展與擴充中。晚近的討論，包括在混合資料型態下的估計，非線性轉換的極限性質、與近單根行為等。固然我們的研究未涵概這些發展，但我們展望這些研究所累積的經驗與技巧可以提供尋找這些新課題答案的原動力。



郭炳伸

學經歷：

國立政治大學國貿系學士(1983)

國立政治大學財政所碩

士(1985)

美國 Rochester 大學經濟學博士(1995)

中華經濟研究院第三所助理研究員(1985)

財政部賦政會副研究員(1987-1989)

國立政治大學國貿系副教授(1995-迄今)