

[首页](#)[概况](#)[研究机构](#)[学者介绍](#)[成果文库](#)[文献数据](#)[培训教育](#)[对外交流](#)

Search the Web

Find It

□ 您的位置： [首页](#) → [数技经济研究杂志](#) → [现实经济问题研究](#)

CEV模型的单位根检验研究

【摘要】CEV模型(Constant Elasticity of Variance Model)作为常用的利率模型，在实证分析中得到了广泛运用，但是其单位根检验一直被忽略或者被默认可以使用迪基 - 富勒检验。本文首次运用Box - Cox变换的技巧，针对CEV模型的单位根检验问题，找到了合适的统计量并且证明其渐进分布存在，然后通过蒙特卡罗方法求出了该统计量的分布表。得到了在大样本的情形下可以沿用迪基 - 富勒检验，但在小样本的情形下与迪基 - 富勒检验有所偏差的结论。

关键词 CEV模型 单位根检验 Box - Cox变换 蒙特卡罗方法