



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