



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

□ 您的位置： 首页 → 数技经济研究杂志 → 现实经济问题研究

## 单因子利率期限结构模型的广义矩估计及对中国货币

**【摘要】**本文在多个著名的单因子利率模型的基础上，提出了一个新的一般模型，其漂移项涵盖了线性和非线性两种形式。并用广义矩方法进行参数估计，在多种指标的比较下得到了一个较好模型。此模型的漂移项为非线性形式，具有显著的均值回复效应，且利率波动对利率水平极为敏感。

关键词 利率模型 广义矩方法 漂移项 均值回复效应

Search the Web

Find It

地址：北京市建国门内大街5号 邮政编码：100732 电话及传真：010-65125895、010-65137561

版权所有 (c) 中国社会科学院数量经济与技术经济研究所

联系我们 E-mail to: iqte@cass.org.cn