



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

## 泛函中心极限定理渐进性与具有GARCH误差项的金融时序单位根检验

**【摘要】** 本文基于分析泛函中心极限定理在高频金融数据单位根检验中的特征与性质，从随机模拟的角度，探讨了有限样本情况下具有GARCH-GED误差项金融时序的ADF单位根检验统计量 $Z_t$ 、 $Z_p$ 的统计性质，着重研究了不同水平下的分位数、模型滞后阶的设定及GED分布参数的变动对其检验统计特性的影响。随机模拟结果显示，若数据生成模型设定为AR-GARCH-GED过程，常用的ADF单位根检验统计量存在不同的统计性质，并对出现这种现象的原因进行了探索。

关键词 单位根过程 GARCH-GED误差 分位数

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