

基于外汇汇率相关结构的多变点分析

蔡霞, 贺广婷, 关静, 李秀敏

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 根据Mixed Gumbel Copula函数和广义Pareto分布, 建立了英镑和欧元两种外汇汇率之间的相关结构模型, 用变点分析方法 讨论相关结构模型中存在的动态变化, 指出这两组外汇回报率之间的相关结构的变化与重大国际金融事件的发生有着密切的联系.

关键词 [极值理论](#) [Copula函数](#) [秩相关性](#) [变点](#) [似然比检验](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [2009030048](#)

通讯作者:

作者个人主页: 蔡霞; 贺广婷; 关静; 李秀敏

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF \(628KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [参考文献\[PDF\]](#)
- ▶ [参考文献](#)

服务与反馈

- ▶ [把本文推荐给朋友](#)
- ▶ [加入我的书架](#)
- ▶ [加入引用管理器](#)
- ▶ [引用本文](#)
- ▶ [Email Alert](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“极值理论”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章

- [蔡霞](#)
- [贺广婷](#)
- [关静](#)
- [李秀敏](#)