



[来稿须知](#)

[编辑流程](#)

[稿件版式](#)

[投稿信箱](#)

[在线期刊](#)

当前位置: [社会科学版](#) >> [第18卷](#) >> [第3期](#)

非参数方法在沪深股市收益率分布的应用

陈娟

(浙江工商大学数量经济系, 浙江杭州 310035)

摘要: 沪深大盘指数的收益率分布函数并不服从通常人们所认为的正态分布。本文采用一种新的方法——非参数核密度估计, 对大盘指数的收益率分布函数进行研究。这种新方法不仅很好地刻画了收益率分布的尖峰和肥尾特征, 而且比一般的正态分布更能捕捉市场的风险特征, 结论也更加准确。

关键词: 收益率; 非参数估计; 核密度函数; 窗宽

[PDF全文下载:](#) [非参数方法在沪深股市收益率分布的应用.pdf](#)