

## 基于危险率函数变点检测的美国次级债危机传染分析

叶五一, 缪柏其, 马宇超

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

**摘要** 金融危机传染的分析是近期国际金融研究中的重要问题,大多数传染效应存在性的检验采用相关性方法.应用危险率函数的变点检测方法检验了传染效应的存在性,并给出了传染程度大小的一种度量方法.首次从持续期的角度对危机传染问题进行分析.最后对全球几个主要国家的指数数据进行了金融危机传染的实证研究,分析了美国次级债危机在各个国家的传染效应.

**关键词** [次级债危机](#) [危险率函数](#) [变点检测](#) [金融传染](#)

分类号

**DOI:**

对应的英文版文章: [2010030431](#)

通讯作者:

作者个人主页: [叶五一](#); [缪柏其](#); [马宇超](#)

### 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#) (618KB)

▶ [\[HTML全文\]](#) (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“次级债危机”的 相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)

· [叶五一](#)

· [缪柏其](#)

· [马宇超](#)