应用概率统计 2008 24 (2): 113－122 ISSN: 1001-4268 CN: 4-414

学术论文

GARCH模型参数变化的残量检验

韩四儿,田铮,王红军

西北工业大学应用数学系, 中国科学院遥感应用研究所遥感科学国家重点实验室

收稿日期 修回日期 网络版发布日期:

摘要 本文研究GARCH模型参数变化的检验问题. 给出残量累积和统计量, 在原假设下得到了统计量的极限分布; 模拟结果表明残量检验可以弥补Kim, Cho和Lee (2000)\ucite{1}提出的平方累积和检验的某些不足, 比如经验势函数值过低的问题.

关键词 累积和检验, GARCH过程, Brown桥

分类号

The Residual Test for Parameters Change in GARCH Models

Han Sier, Tian Zheng, Wang Hongjun

Department of Mathematics, Northwestern Polytechnical University, State Key Laboratory of Remote Sensing Science, Jointly Sponsored by the Institute of Remote Sensing Applications of Chinese Academy of Sciences and Beijing Normal University

Abstract This paper studies the problem of testing for parameter change in GARCH models. We proposed residual cumulative sum test statistic and obtained the limiting distribution of test statistic under null hypothesis. The results of a simulation study show that the residual cumulative test can offset the drawbacks, such as low powers of the squares cumulative sum test proposed by Kim, Cho and Lee (2000)[1] and the test is also applied to real data analysis.

Key words Cumulative sum test, GARCH process, Brown bridge

DOI

扩展功能

本文信息

- Supporting info
- PDF(241KB)
- [HTML全文](0KB)
- 参考文献

服务与反馈

- 把本文推荐给朋友
- 复制索引
- Email Alert
- 文章反馈
- 浏览反馈信息

相关信息

- 本刊中 包含“累积和检验, GARCH过程, Brown桥”的 相关文章
- 本文作者相关文章
  - 韩四儿
  - 田铮
  - 王红军

通讯作者 韩四儿