

β -ARCH模型的经验似然推断

黄晓薇(1), 宋立新(2)

(1)对外经济贸易大学金融学院, 北京 100029; (2)大连理工大学应用数学系, 大连 116024

收稿日期 2006-9-23 修回日期 网络版发布日期 2007-3-5 接受日期

摘要

研究 β -ARCH模型的经验似然估计及相应似然比统计量的渐近性质, 证明了相合性和极限分布.

关键词 [\$\beta\$ -ARCH模型](#) [经验似然](#) [相合性](#) [渐近正态性](#)

分类号 [62F12](#), [62F05](#)

EMPIRICAL LIKELIHOOD INFERENCE ABOUT β -ARCH MODEL

Huang Xiaowei(1), Song Lixin(2)

(1)School of Finance, University of International Business and Economics, Beijing 100029; (2)Department of Applied Mathematics, Dalian University of Technology, Dalian 116024

Abstract

This paper considers the asymptotic properties of the empirical likelihood and its likelihood ratio statistic about β -ARCH model, and obtains the consistency and the limit distribution.

Key words [\$\beta\$ -ARCH](#) [empirical likelihood](#) [consistency](#) [asymptotic normality](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF\(360KB\)](#)

▶ [HTML全文\(0KB\)](#)

▶ [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](#)

▶ [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“ \$\beta\$ -ARCH模型”
的 相关文章](#)

▶ [本文作者相关文章](#)

· [黄晓薇](#)

· [宋立新](#)