

重尾指数估计中阈值 $k$ 的简便优化估计

刘维奇,邢红卫

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 重尾分布在风险管理和金融领域有极为重要的应用价值. 提出了一种选取重尾指数估计阈值 $k$ 的解析方法,称为简便优化估计. 并且利用Hill估计和已知重尾分布进行Monte-Carlo模拟,发现简便优化方法与Sum-plot方法和Bootstrap方法具有同样的精确性与稳健性,三种方法都能得到令人满意的结果. 简便优化方法在精确性方面似乎略占优势,计算方法简单,且不受分布类型和重尾指数范围的影响,在分布为Pareto型时基于简便优化方法的Hill估计依然具有相合性.

关键词 [Bootstrap方法](#) [简便优化方法](#) [相合性](#)

## 扩展功能

本文信息

▶ [Supporting info](#)

▶ [PDF](#)(1228KB)

▶ [\[HTML全文\]](#)(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“Bootstrap方法”的相关文章](#)

▶ 本文作者相关文章

· [刘维奇](#)

· [邢红卫](#)