

论文

基于Gaussian Copula与t-Copula的沪深股指相关性分析

杨兴民^{1,2},刘保东^{1*},李娟²

1. 山东大学 数学与系统科学学院, 山东 济南 250100; 2. 鲁东大学 数学与信息学院, 山东 烟台 264025

摘要:

针对沪深股指,讨论了Gaussian Copula与t-Copula的密度函数,并进行相关性建模,采用二步估计法对所建模型进行参数估计并给出了相关性指标。最后,通过Monte Carlo模拟的方法比较了Copula关联结构之间的差异。

关键词: Gaussian Copula t-Copula 相关性分析

Correlation analysis of the Shanghai-Shenzhen stock index based on Gaussian Copula and t-Copula

YANG Xing-min^{1,2},LIU Bao-dong^{1*},LI Juan²

1. School of Mathematics and System Sciences, Shandong University, Jinan 250100, Shandong; 2. School of Mathematics and Information, Ludong University, Yantai 264025

Abstract:

Gaussian Copula and t-Copula density functions were discussed according to the Shanghai-Shenzhen stock index, and a correlation model was provided. The parameter of this model was estimated by the two-step estimating method and the relative index was given. Finally, the difference between Copula correlation structures was compared by the Monte Carlo method.

Keywords: Gaussian Copula t-Copula correlation analysis

收稿日期 1900-01-01 修回日期 1900-01-01 网络版发布日期 2006-10-24

DOI:

基金项目:

通讯作者: 杨兴民

作者简介:

本刊中的类似文章

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(217KB)

[HTML全文](OKB)

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

文章反馈

浏览反馈信息

本文关键词相关文章

▶ Gaussian Copula

▶ t-Copula

▶ 相关性分析

本文作者相关文章

▶ 杨兴民

▶ 刘保东*

▶ 李娟