

研究通讯

ARCH模型的研究与探讨

[苗实](#) [刘海龙](#) [潘德惠](#)

(东北大学工商管理学院)

Abstract 自回归条件异方差(ARCH)模型是近年来新发展起来的时间序列模型,它反映了随机过程的一种特殊特性:即方差随时间变化而变化,且具有丛集性、波动性. ARCH模型已广泛地应用于经济领域的建模及研究过程中. 本文介绍了ARCH模型的特点,它的参数估计和检验,以及ARCH模型的发展情况.

Keywords [ARCH; 条件异方差; 丛集性; 波动性](#)

收稿日期

修回日期

通讯作者

DOI

PACS: TP13