

关于二元正态分布的尾部独立在服务器做了一个图，时间允许可以看一下

$$\lambda = 2 - L(1, 1)$$

目前有对 L 的比较好的估计，具有相合性和渐近正态性，但是不能用来做检验，因为在渐近独立的时候，方差也会退化。

Ledford and Tawn(1996)定义了一个指标 residual dependence index η , $\eta < 1$ 的时候代表的都是渐近独立，只有在 $\eta = 1$ 的时候才是渐近相关的。

power of test : 在备择假设为真的时候，正确拒绝原假设的概率