國立中山大學應用數學系
學術演講

講　者：Professor Sangyeol Lee
Department of Statistics, Seoul National University, Korea

講　題：On Estimates-, Score Vector- and Residual-based CUSUM Tests

時　間：2017/02/23（星期四）14:10 ~ 16:00

地　點：理學院四樓理 SC 4009-1 室

茶　會：16:00 於理 SC 4010 室 (系辦公室)

摘 要

In this talk, we consider the problem of testing for a parameter change. We suggest three types of cumulative sum (CUSUM) tests, namely, estimates-, score vector- and residual-based CUSUM tests. In particular, we focus on ARMA-GARCH models. It is shown that under regularity conditions, their limiting null distributions are the sup of Brownian bridges. A simulation study and real data analysis are conducted for illustration.

中山大學應用數學系

敬 請 公 告！ 歡 迎 參 加！

應用數學系：http://math.nsysu.edu.tw

校園地圖：http://math.nsysu.edu.tw/ezfiles/87/1087/img/779/NSYSUMAPmath990705.jpg

交通資訊：http://www.nsysu.edu.tw/files/90-1000-7.php?Lang=zh-tw

應用數學系　校園地圖　交通資訊