

國立中山大學應用數學系

學術演講

講者：Prof. Sangyeol Lee

Dept. of Statistics, Seoul National
University, Korea

講題：Recent development of change point test for
time series

時間：2019/03/28（星期四）14:10 ~ 15:00

地點：理學院四樓理 SC 4009-1 室

茶會：15:00 於理 SC 4010 室（系辦公室）

摘要

In this talk, we introduce the CUSUM-based change point test for time series models such as ARMA, GARCH and location-scale models. We review the estimate, residual, score vector-based CUSUM tests and introduce the location and scale-based CUSUM test. Moreover, the CUSUM method is applied to dynamic panel models. Some empirical examples are provided 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/var/file/183/1183/img/779/nsysu_math_map.jpg

交通資訊：<https://www.nsysu.edu.tw/p/412-1000-4132.php?Lang=zh-tw>



應用數學系



校園地圖



交通資訊