

عنوان مقاله:

مدل بندی سری های زمانی بیش پراکنده با استفاده از مدل های COM-POISS INGARCH

محل انتشار:

سومین کنفرانس ریاضیات مالی و کاربردها (سال: 1391)

تعداد صفحات اصل مقاله: 7

نویسنده:

نرگس احمدزاده گلی - دانشگاه آزاد اسلامی واحد علوم و تحقیقات تهران

خلاصه مقاله:

سری های زمانی شمارشی بسیاری با بیش پراکندگی مواجه می شوند. مدل های INGARCH یک ابزار مناسب برای مدل بندی سری های زمانی شمارشی است. مدل های پواسن و دوجمله ای منفی تنها برای بیش پراکندگی مناسب هستند. همچنین مدل های پواسن دوگانه و پواسن تعمیم یافته، هم بیش پراکندگی و هم کم پراکندگی را می توانند مدل بندی کنند. اما این دو مدل یک سری محدودیت و نقص دارند. مدل های COM-POISSON در مدل بندی دامنه وسیعی از بیش پراکندگی و کم پراکندگی (تنها با دو پارامتر) منعطف هستند. بنابراین مدل جدیدی از INGARCH بر پایه این توزیع معرفی خواهیم کرد و شرط ایستایی آن را بیان می کنیم. همچنین میانگین، واریانس و تابع خودهمبستگی و برخی از ویژگی های این مدل را مطالعه می کنیم و پیرامون مراحل برآورد ماکزیمم درستنمایی برای پارامترهای مورد علاقه بحث خواهیم کرد.

کلمات کلیدی:

سری های زمانی بیش پراکنده، بیش پراکندگی، کم پراکندگی COM-POISSON

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/352621>

