

عنوان مقاله:

مطالعه کاربرد توزیع فیسک در داده های اقتصادی و مالی

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی حسابداری و مدیریت در هزاره سوم (سال: 1395)

تعداد صفحات اصل مقاله: 9

نویسندگان:

پرستو مدبری - گروه ریاضی و آمار، واحد لاهیجان، دانشگاه آزاد اسلامی، لاهیجان، ایران

هانیه پناهی - گروه ریاضی و آمار، واحد لاهیجان، دانشگاه آزاد اسلامی، لاهیجان، ایران

خلاصه مقاله:

تعیین یک مدل پارامتری در داده های اقتصادی و مالی به منظور پیش بینی داده های آینده از ارزش و اهمیت بالایی برخوردار است. هدف این مقاله مطالعه توزیع فیسک (لگ لجستیک) و - بررسی برازندگی آن در داده های اقتصادی است. توزیع فیسک به طور گسترده ای در مدل بندی پدیده های استوکستیک مورد استفاده قرار گرفته است. در این مطالعه از داده های مربوط به دستمزد سالانه کارگران خط تولید برای نشان دادن برازندگی این توزیع استفاده شده است. پارامترهای توزیع با استفاده از روش درستمایی ماکزیمم برآورد شده و با استفاده از ماتریس اطلاع فیشر، فواصل اطمینان بنا شده است. سپس آزمون های برازندگی مانند آزمون کلموگروف اسمیرنف و اندرسون دارلینگ برای ارزیابی مناسب بودن این توزیع در داده های - ذکر شده مورد استفاده قرار گرفته است. همچنین روشهای گرافیکی مانند روش چندک چندک، - به منظور نشان دادن برازندگی این توزیع در داده های اقتصادی و مالی مورد ارزیابی قرار گرفته اند.

کلمات کلیدی:

توزیع فیسک، برآورد درستمایی ماکزیمم، آزمون های برازندگی، داده های دستمزد سالانه کارگران

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/626104>

