

عنوان مقاله:

آزمون برای ریشه های واحد در یک مدل سری زمانی نامانا

محل انتشار:

دومین کنفرانس بین المللی فناوری های نوین در علوم (سال: 1397)

تعداد صفحات اصل مقاله: 6

نویسندگان:

مهدی شمس - استادیار گروه آمار، دانشکده علوم ریاضی، دانشگاه کاشان، اصفهان، ایران

الهام همائی - دانشجوی کارشناسی آمار، دانشگاه کاشان، اصفهان، ایران

خلاصه مقاله:

اخیرا روش های برای تشخیص ریشه های واحد در مدل های سری زمانی اتورگرسیو و اتورگرسیو میانگین متحرک پیشنهاد شده است. حضور یک ریشه واحد نشان می دهد که سری زمانی مانا نیست، اما این تفاضل گیری آن را به حالت مانا کاهش می دهد. در این مقاله یک آزمون برای ریشه های واحد معرفی می شود.

کلمات کلیدی:

سری زمانی اتورگرسیو-میانگین متحرک، تابع اتوکواریانس، ریشه واحد، سازگاری

لینک ثابت مقاله در پایگاه سیویلیکا:

<https://civilica.com/doc/899417>

