

SZEMINÁRIUM

Az ELTE Valószínűségelméleti és Statisztika Tanszék szemináriumán

2010. október 8-án 10 órakor

ISPÁNY MÁRTON (Debreceni Egyetem, Informatikai Kar)

Aszimptotikus eredmények instabil egész értékű idősorokra

címmel tart előadást.

Helyszín: 1117 Budapest, Pázmány Péter s. 1/C, D 3-316. terem.

Kivonat:

Az utóbbi években több száz cikk jelent meg egész értékű idősorokkal kapcsolatban, amelyek akkor lépnek fel ha diszkrét jelenségek, pl. darab- vagy esetszámok időbeni fejlődését szeretnénk leírni. Bár számos párhuzam húzható a valós értékű idősorokkal, mind az eredményekben, mind az alkalmazott módszerekben nem várt, korábban nem ismert jelenségek lépnek fel. Az előadásban egész értékű autoregressziós folyamatok (ún. INAR modellek) aszimptotikájával foglalkozunk, elsősorban az ún. instabil vagy kritikus esetben. Egy INAR modellt akkor nevezünk instablnak, ha karakterisztikus polinomjának az 1 gyöke. Az előadásban ismertetendő fő eredmény azt mondja ki, hogy egy ilyen folyamat alkalmas normálás mellett úgy viselkedik, mint egy négyzetes Bessel-folyamat. Tárgyaljuk az INAR modellek kapcsolatát a heteroszkedasztikus idősor modellekkel, illetve az elágazó folyamatokkal. Végül néhány paraméterbecsléssel kapcsolatos kérdéstről esik szó, nyílt problémák felvetésével együtt. Az eredmények nagy részben Barczy Mátyással és Pap Gyulával közösek.