23 a 28
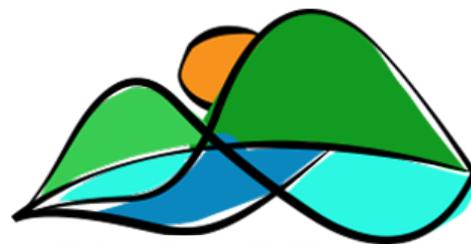
Fonte Colina Verde

Página Inicial » Inscrições Científicas » Trabalhos

Dados do Trabalho

Título

INVARIANT DISTRIBUTION OF A NON LINEAR TIME SERIES WITH UNIFORM NOISE

Resumo

We prove the existence and uniqueness of the invariant distribution of a non linear autoregressive time series of order one with uniformly distributed independent noise. The non linearity is of square root type. We propose an algorithm to determine this distribution. We prove that this distribution must satisfy a functional integral equation. Transforming this integral equation in a functional differential equation with both delay and scaling we were able to prove the existence of a one parameter infinite class of non negative solutions to the integral equation. Within this class there is only one possible choice of the parameter that generates a probability density function, which is the solution of our initial problem.

Palavras-chave

Invariant distribution; Non linear time series; Functional integral equation.

Área

Séries Temporais e Econometria

Autores

J.C.S. de Miranda

FECHAR

⬆ (JAVASCRIPT:VOID(0))

Organização

Associação Brasileira de Estatística

ELO EVENTOS
CIENTÍFICOS | EMPRESARIAIS | CORPORATIVOS

Apoio

CAPES

FAPESP
FUNDAÇÃO DE AMPARO À PESQUISA
DO ESTADO DE SÃO PAULO

Patrocínio

CONRE·3
Conselho Regional de Estatística da 3ª Região (SP-PR-MT-MS)

Minitab

timberlake
Estatística | Econometria | Previsão

Tecnologia para eventos

inteligência
(http://www.inteligenciaweb.com.br)

Formas de pagamento

VISA   MasterCard   DISCOVER NETWORK   elo   Aura   BOLETO

Segurança

GODADDY®
VERIFICADO E PROTEGIDO
VERIFICAR SEGURANÇA

Google
Safe Browsing
(https://www.google.com/safebrowsing/diagnos
site=iweventos.com.br)