

國立中山大學應用數學系

學術演講

講者：繆柏其教授

中國科學技術大學統計與金融系

講題：Unit Root Test Based on the Limiting Spectral Distribution of Large Dimensional Random Matrix

時間：2014/05/30（星期五）14：10～15：00

地點：理學院四樓理 SC 4009-1 室

茶會：16:00 於理 SC 4010 室（系辦公室）

摘要

In this paper we propose a new method to test unit root of time series based on the relation between limiting spectral distribution of large dimensional random matrix and spectral distribution of time series. Simulation shows it can be done.

中山大學應用數學系

敬請公告！歡迎參加！

應用數學系：<http://math.nsysu.edu.tw>

校園地圖：<http://web.nsysu.edu.tw/files/11-1000-1503.php?Lang=zh-tw>

交通資訊：<http://www.nsysu.edu.tw/files/90-1000-7.php?Lang=zh-tw>



應用數學系



校園地圖



交通資訊