

國立中山大學應用數學系

學術演講

- 講者：Professor Sangyeol Lee
Department of Statistics, Seoul National University
- 講題：Asymptotics for Expectile Regression Models with Application to Expected Shortfall Estimation
- 時間：2015/1/28 (星期三) 11:10 ~ 12:00
- 地點：理學院四樓理 SC 4009-1 室
- 茶會：10:30 於理 SC 4010 室 (系辦公室)

摘要

In this study, we consider nonlinear expectile regression models to estimate conditional expected shortfall (ES) and Value-at-Risk (VaR). We investigate the asymptotic properties of the ALS estimates in nonlinear models with heteroscedasticity and apply these to the expected shortfall estimation. To showcase our result, we conduct a real data analysis.

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