

Metody repróbkiwania dla niestacjonarnych szeregów czasowych

Jacek Leśkow

Wyższa Szkoła Biznesu WSB-NLU Nowy Sącz ul. Zielona 27

e-mail:

leskow@wsb-nlu.edu.pl

W ostatnich dziesięciu latach rozwinęły się techniki repróbkiwania typu bootstrap lub subsampling dla niestacjonarnych szeregów czasowych (Politis (1999), Leśkow i in (2008)). Na podstawie tych rezultatów można uzyskać zmodyfikowane testy stacjonarności wykraczające poza standardowe metody oparte na modelach ARMA. Celem referatu jest krótka prezentacja rezultatów opartych na metodzie subsamplingu oraz ich zastosowanie w analizie stacjonarności szeregów czasowych.

Literatura

- [1] Politis, D.N, Romano, J.P, Wolf, M. (1999), *Subsampling*, Springer Verlag
- [2] Leśkow, J., Lenart, Ł., Synowiecki, R. (2008), *Subsampling in testing autocovariance for periodically correlated time series*, Journal of Time Series Analysis 29, pp.995-1018