The likelihood of multivariate GARCH models is III-conditioned [

Jerez, Miguel

Universidad Complutense, Instituto Complutense de Análisis Económico,
1999

Monografía

Se propone una transforamción lineal de los datos que no solo estabiliza el cálculo de verosimilitud de procesos GARCH, sino que ayuda a analizar las propiedades estadísticas de los datos

https://rebiunoda.pro.baratznet.cloud:38443/OpacDiscovery/public/catalog/detail/b2FpOmNlbGVicmF0aW9uOmVzLmJhcmF0ei5yZW4vMTc5MDgwODQ

Título: The likelihood of multivariate GARCH models is III-conditioned Recurso electrónico] Miguel Jerez, José Casal, Sonia Sotoca

Editorial: Madrid Universidad Complutense, Instituto Complutense de Análisis Económico 1999

Descripción física: 29 p. 21 cm

Mención de serie: Documento de trabajo / Instituto Complutense de Análisis Económico 9904

Materia: Análisis multivariante

Autores: Casal, José, coaut Sotoca, Sonia, coaut

Baratz Innovación Documental

- Gran Vía, 59 28013 Madrid
- (+34) 91 456 03 60
- informa@baratz.es