

高竹嵐教授 / 統計學研究所

再生理論、馬可夫鏈與隱馬可夫鏈、變點估計、與相關財務應用

一、再生理論

- 一維非線性馬可夫再生理論。
- 高維非線性再生理論，以及其與一維非線性馬可夫在生理論之關聯性。
- 再生理論在工業統計（如MCUSUM）與財務統計（如信用風險）上之應用。

二、馬可夫鏈與隱馬可夫鏈

- 利用邊際概率估計隱馬可夫鏈之狀態數量。

三、變點估計

- 利用邊際概率估計未知數量之變點。

四、相關財務應用

- 信用風險、信用評等與相依違約風險。