

<<应用时间序列分析>>

图书基本信息

书名：<<应用时间序列分析>>

13位ISBN编号：9787503759338

10位ISBN编号：750375933X

出版时间：2010-5

出版时间：中国统计出版社

作者：王振龙

页数：344

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

<<应用时间序列分析>>

内容概要

《应用时间序列分析（第2版）》从应用的角度出发，试图借助计算机的存贮功能和计算功能来抽象掉其深奥的数学理论和复杂的运算，从而使只具一般数学知识的读者便可掌握和运用时间序列分析方法。

在阐述种，尽可能回避严格的数学推导和证明，而从系统运动的惯性（即记忆性）加以解释和展开，或者说，《普通高等教育“十一五”国家级规划教材：应用时间序列分析（第2版）》把时序分析看作是一种统计分析工具，而不是数学的一个分支理论。

对于“工具”来说，使用者只要知道其特性、功能和使用方法以及使用过程中应注意的有关事项就足够了，至于其制造原理及过程，当然熟悉更好，不了解也无关乎其使用。

鉴于这样的认识，全书没有运用深奥的定理，因而也就勿须定理证明。

模型的形成来自于对系统记忆性的长短及其特性的剖析，一些数学推导也只涉及高等数学、线性代数和概率论与数理统计的一般知识。

<<应用时间序列分析>>

书籍目录

第1章 绪论	11	1.1 时间序列分析的一般问题	21	1.2 时间序列基本样式	91	1.3 时间序列分析工具	29	本章小结	39	思考与练习	40								
第2章 时间序列的预处理	41	2.1 时间序列的建立	41	2.2 非平稳时间序列平稳化的处理	42	2.3 异常值的处理	50	本章小结	58	思考与练习	58								
第3章 平稳时间序列模型	59	3.1 线性平稳时间序列的基本概念	59	3.2 一阶自回归模型	68	3.3 一般自回归模型	71	3.4 移动平均模型	74	3.5 自回归移动平均模型	75	本章小结	80	思考与练习	81				
第4章 ARMA模型的特性	82	4.1 格林函数和平稳性	82	4.2 逆函数和可逆性	106	4.3 自协方差函数	112	4.4 自谱	121	本章小结	129	思考与练习	130						
第5章 平稳时间序列模型的建	132	5.1 模型识别	133	5.2 模型定阶	136	5.3 模型参数估计	142	5.4 模型的适应性检验	145	5.5 Pandit-Wu建模方法	148	5.6 建模实例	150	本章小结	155	思考与练习	156		
第6章 平稳时间序列预测	157	6.1 条件期望预测	158	6.2 预测的三种形式	159	6.3 预测值的适时修正	167	本章小结	169	思考与练习	170								
第7章 趋势性时间序列模型	171	7.1 趋势性时间序列的重要特	171	7.2 随机时间序列的趋势性检验	172	7.3 平稳化的方法	178	7.4 趋势模型	183	本章小结	200	思考与练习	201						
第8章 季节性时间序列分析方法	203	8.1 季节时间序列的重要特征	203	8.2 季节性时间序列模	205	8.3 季节性检验	209	8.4 季节时间序列模型的建立	212	8.5 X-12-ARIMA方法简介	220	本章小结	232	思考与练习	233				
第9章 条件异方差模型	235	9.1 基本条件异方差模型的转性	236	9.2 条件异方差模型的建立	240	9.3 几种扩展模型	251	本章小结	256	思考与练习	257								
第10章 传递函数模型	258	10.1 模型简介	259	10.2 传递函数模型的识别	263	10.3 传递函数模型的拟合与检验	270	10.4 干预模型	274	本章小结	280	思考与练习	281						
第11章 非线性与多元时间序列模型	283	11.1 非线性时间序列	283	11.2 多元平稳序列	286	11.3 多元AR模型	287	11.4 伪回归及平稳性检验	289	11.5 协整检验	294	本章小结	296	思考与练习	296	参考文献	297	附录	297
数据资料	298	附录	常用统计量分布表	339															

<<应用时间序列分析>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>