

<<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：9787030188854

10位ISBN编号：7030188853

出版时间：2007-5

出版时间：科学

作者：王振龙

页数：250

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》是根据教育部统计学教学指导分委员会新制定的《统计学专业教学规范（授经济学学位）》所设计的课程体系和教学内容编写的。

《应用时间序列分析》遵循“通俗、易懂、实用”的原则，试图借助计算机的存储功能和计算功能来抽象掉时序分析方法的深奥数学理论和复杂运算，从而使具有一般数学知识的读者可轻松掌握和运用时间序列分析方法。

在阐述中，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，《应用时间序列分析》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。全书分10章系统地介绍了时间序列分析的基本理论、基本思想、基本方法及其应用，各章均附有思考与练习，书后还附有例题用的数据。

《应用时间序列分析》配有教学光盘，光盘中备有例题的SAS程序、PowerPoint教学课件和部分思考与练习答案，便于教师组织教学和学生进行学习。

《应用时间序列分析》主要是作为经济与管理类统计学专业本科生的基础教材，也可用作经济与管理类研究生的教学参考书。

对于自学时间序列分析方法的读者来说，更是一本必备的入门教材。

## &lt;&lt;应用时间序列分析&gt;&gt;

## 书籍目录

总序前言第一章 绪论第一节 时间序列分析的一般问题第二节 时间序列的建立第三节 确定性时序分析方法概述第四节 随机时序分析的几个基本概念本章小结思考与练习第二章 平稳时间序列模型第一节 一阶自回归模型第二节 一般自回归模型第三节 移动平均模型第四节 自回归移动平均模型本章小结思考与练习第三章 ARMA模型的特性第一节 格林函数和平稳性第二节 逆函数和可逆性第三节 自协方差函数第四节 自谱本章小结思考与练习第四章 平稳时间序列模型的建立第一节 模型识别第二节 模型定阶第三节 模型参数估计第四节 模型的适应性检验第五节 Pandit-Wu建模方法第六节 建模实例本章小结思考与练习第五章 平稳时间序列预测第一节 条件期望预测第二节 预测的三种形式第三节 预测值的适时修正本章小结思考与练习第六章 趋势模型第一节 趋势性时间序列的重要特征第二节 随机时间序列的趋势性检验第三节 平稳化方法第四节 趋势模型本章小结思考与练习第七章 季节模型第一节 季节时间序列的重要特征第二节 季节性时间序列模型第三节 季节性检验第四节 季节时间序列模型的建立第五节 X-11方法简介本章小结思考与练习第八章 条件异方差模型第一节 条件异方差模型第二节 条件异方差模型的建立第三节 几种扩展模型本章小结思考与练习第九章 传递函数模型第一节 模型简介第二节 传递函数模型的识别第三节 传递函数的拟合与检验第四节 干预模型本章小结思考与练习第十章 异常值分析第一节 含异常值的ARIMA模型第二节 异常值的检测第三节 异常值分析的实例本章小结思考与练习参考文献附录附录A X-11报表与说明附录B 数据资料附录C 统计表

<<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>