

<<时间序列分析>>

图书基本信息

书名：<<时间序列分析>>

13位ISBN编号：9787111338642

10位ISBN编号：7111338642

出版时间：2011-4

出版时间：机械工业出版社

作者：博克斯

页数：426

译者：王成璋

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>

<<时间序列分析>>

内容概要

本书内容始终都是时间序列领域的权威。
第4版仍然分为5个部分，相对第3版新增内容主要有非线性和长记忆模型、多元时间序列分析以及前馈控制，其余各章节根据现实和教学需要均有不同程度的更新。
在本书中，几位统计学大师用极其通俗的语言，结合大量的实例，阐明了时间序列分析的精髓。
本书内容十分丰富，叙述简明，强调实际应用。
相信每一位研读此书的读者都会获益匪浅。

本书可作为统计和相关专业高年级本科生或研究生教材，也可以作为统计专业技术人员的参考书

<<时间序列分析>>

作者简介

作者：(美国)博克斯

<<时间序列分析>>

书籍目录

- 译者序
- 第4版前言
- 第3版前言
- 教学建议
- 第1章 引言
- 第一部分 随机模型及其预测
 - 第2章 平衡过程的自相关函数和谱
 - 第3章 线性平稳模型
 - 第4章 线性非平稳模型
 - 第5章 预测
- 第二部分 随机模型的建立
 - 第6章 模型识别
 - 第7章 模型的估计
 - 第8章 模型的诊断检验
 - 第9章 季节模型
 - 第10章 非线性和长记忆模糊
- 第三部分 传递函数模型和多变量模型的建立
 - 第11章 传递函数模型
 - 第12章 传递函数模型的识别、拟合及检验
 - 第13章 干预分析模型和异常值检测
 - 第14章 多元时间序列分析
- 第四部分 离散控制方案的设计
 - 第15章 过程控制的各个方面
- 第五部分 图表
- 图表汇集
- 正文和习题中使用的时序序列汇集
- 习题

<<时间序列分析>>

章节摘录

第1章 引言 时间序列是根据时间顺序得到的一系列观测值。

许多数据都是以时间序列的形式呈现的，如：一个工厂装船货物数量的月度序列、公路事故发生数量的周度序列、一个化学过程的每小时观测值序列，等等。

时间序列数据涉及的领域广泛，包括：经济学、商学、工程学、自然科学（尤其是地理物理学和气象学），以及社会科学。

有关这一类数据的例子将是我们关心和讨论的，并将在时间序列图形中给予展示。

时间序列固有的典型特征就是，相邻观测值之间的相互依赖性。

在一个时间序列中，观测值之间的相互依赖性具有极大的实用价值。

时间序列分析正是讨论这种观测值之间相互依赖性的一种分析技术。

这要求为时间序列数据发展出随机动态模型，并在相关领域应用这些模型。

在本书随后的各章中，我们将展示如何建立、识别、拟合和检验时间序列模型与动态系统的方法。讨论的这些方法适用于离散系统（数据抽样），即系统观测值的采集是在相同时间间隔中。

我们在五个重要领域演示时间序列和动态系统的应用： 1) 根据当前值和过去值，预测一个时间序列的未来值。

2) 根据系统惯性，测算传递函数——即测算一个动态输入—输出模型，使这一模型可以显示任意给定的输入序列对于系统输出的影响。

3) 使用传递函数模型中的指示性输入变量，来展示和评估一个异常干扰事件对时间序列特征的影响。

4) 检查几个相关的时间序列变量的相关性，测算出适当的多变量动态模型，以表达基于时间上的变量间的联合关系。

5) 通过补偿目标输出系统的潜在偏差，来设计简单的控制方案。并进一步调整输入序列的值。

……

<<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>