

<<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：9787300132655

10位ISBN编号：7300132650

出版时间：2011-3

出版时间：中国人民大学出版社

作者：易丹辉

页数：283

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

事物随时间变化是最常见的现象，也最容易收集数据。

按时间顺序记录的一系列数据，即构成时间序列。

时间序列分析就是充分利用这些数据，挖掘事物随时间变化规律的方法。

《时间序列分析：方法与应用》融合单变量与多变量时间序列分析，通过大量实际数据的处理，说明各种方法的基本原理及其在实际中的应用，特别说明了一些实际应用中需要注意的问题。

## <<时间序列分析>>

### 作者简介

易丹辉，中国人民大学统计学院教授、博士生导师。  
主要从事统计方法在经济、金融、保险、医疗、管理等领域应用的研究。  
研究方向：风险管理与保险、预测与决策。

## &lt;&lt;时间序列分析&gt;&gt;

## 书籍目录

- 第一章 趋势模型
  - 第一节 趋势模型类型
  - 第二节 模型选择
  - 第三节 参数估计
  - 第四节 模型分析与评价
  - 附录1-A 生命周期曲线拐点
  - 附录1-B 商品生命周期判定
- 第二章 季节模型
  - 第一节 季节性水平模型
  - 第二节 季节性交乘趋向模型
  - 第三节 季节性迭加趋向模型
- 第三章 ARMA模型
  - 第一节 概述
  - 第二节 时序特性的分析
  - 第三节 ARMA模型及其改进
  - 第四节 随机时序模型的建立
  - 第五节 时序模型预测
  - 附录3-A 平稳过程的定义
  - 附录3-B 时间序列自相关系数的公式
  - 附录3-C 偏自相关函数
  - 附录3-D 模型参数的估计
  - 附录3-E AIC的计算
- 第四章 ARCH类模型
  - 第一节 单位根过程
  - 第二节 ARCH模型的基本形式
  - 第三节 广义ARCH模型
  - 第四节 ARCH模型的拓广形式
  - 附录4-A 零频谱估计
  - 附录4-B 自动窗宽和滞后长度选择
  - 附录4-C ARCH定义的理解
- 第五章 两序列的协整和误差修正模型
  - 第一节 含虚拟变量的回归模型
  - 第二节 Granger因果检验
  - 第三节 协整含义及检验
  - 第四节 误差修正模型
  - 附录5-A 工具变量和两阶段最小二乘
- 第六章 向量自回归模型
  - 第一节 非结构化VAR模型
  - 第二节 脉冲响应与方差分解
  - 第三节 结构VAR模型
  - 第四节 向量误差修正模型
  - 附录6-A 似无关回归
- 第七章 Panel Data模型
  - 第一节 模型的基本问题
  - 第二节 固定效应模型

<<时间序列分析>>

第三节 随机效应模型

第四节 单位根检验与协整检验

附录7-A 广义最小二乘

附录7-B 广义矩估计

附表1

附表2

附表3

附表4

附表5

附表6

参考文献

<<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>