

<<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：9787301063477

10位ISBN编号：7301063474

出版时间：2004-9

出版时间：北京大学出版社

作者：何书元 编

页数：332

字数：300000

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

时间序列分析是概率统计学科中应用性较强的一个分支，在金融经济、气象水文、信号处理、机械振动等众多领域有着广泛的应用。

本书是高等院校“应用时间序列分析”课程的教材，较系统讲授应用时间序列分析的基本理论、方法以及应用。

本书以时间序列的线性模型和平稳序列的谱分析为主线，介绍平稳时间序列的基本知识、常用的建模和预测方法，目的是使学生对时间序列的应用理论和方法有基本的了解，能够用时间序列的基本方法处理简单的时间序列数据。

全书共分九章，内容包括：时间序列的分解、平稳序列、线性平稳序列、ARMA模型、时间序列的预报，加窗谱估计和多维平稳序列介绍。

每节配有适量习题和部分计算机作业，可供教师和学生选用。

本书可作为综合性大学、工科大学和高等师范院校本科生的“应用时间序列分析”课程的教材或教学参考书，也可以作为工程技术人员和应用工作者的参考书。

<<应用时间序列分析>>

作者简介

何书元，北京大学数学科学学院教授、博士，从事时间序列分析、应用随机过程和概率极限定理的教学和科研工作。

近年的研究方向是不完全数据的统计分析。

<<应用时间序列分析>>

书籍目录

第一章 时间序列 时间序列的分解 平衡序列 线性平衡序列和线性滤波 生态时间序列和随机变量的收敛性 严平稳序列及其遍历性 Hilbert空间中的平衡序列 平衡序列的谱函数 离散谱序列及其周期性
第二章 自回归模型 推移算子和常系数差分方程 自回归模型及其平衡性 AR序列的谱密度和Yule-Walker方程 平衡序列的偏相关系数和Levinson递推公式 AR序列举例第三章 滑动平均模型与自回归滑动平均模型 滑动平均模型 自回归滑动平均模型 广义ARMA模型和ARIMA模型介绍第四章 均值和自协方差函数的估计 均值的估计 自协方差函数的估计 白噪声检验 第五章 时间序列的预报 最佳线性预测的基本性质 非决定性平衡序列及其Wold表示 时间序列的递推预测 ARMA序列的递推预测第六章 ARMA模型的参数估计 AR模型的参数估计 MA模型的参数估计 ARMA模型的参数估计 求和ARIMA模型及季节ARIMA模型的参数估计第七章 潜周期模型的参数估计 潜周期模型的参数估计 混合自回归周期模型的参数估计 二维随机场的潜周期模型的参数估计第八章 时间序列的谱估计 平称序列的谱表示 平衡序列的周期图 加窗谱估计 加窗谱估计的比较第九章 多维平稳序列介绍 多维平稳序列 多维平衡序列的均值和自协方差函数的估计 多维AR序列 多维平衡序列的谱分析附录A 部分定理的证明附录B 时间序列数据 索引 符号说明 参考文献

<<应用时间序列分析>>

编辑推荐

《应用时间序列分析》可作为综合性大学、工科大学和高等师范院校本科生的"应用时间序列分析"课程的教材或教学参考书,也可以作为工程技术人员和应用工作者的参考书。

<<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>