

<<非线性自回归模型的非参数方法及应>>

图书基本信息

书名：<<非线性自回归模型的非参数方法及应用>>

13位ISBN编号：9787030359520

10位ISBN编号：7030359526

出版时间：2013-1

出版时间：科学出版社

作者：陈耀辉

页数：136

字数：189000

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>

<<非线性自回归模型的非参数方法及应>>

内容概要

非线性自回归模型是时间序列分析中一类重要的模型，而且和实际应用有密切关系。

《非线性自回归模型的非参数方法及应用》用非参数方法系统地研究非线性自回归模型的基本理论、方法及应用，其中包括核估计的中心极限定理、自助估计法在非线形自回归模型中的应用、线性和非线性自回归模型阶的确定、欧式期权的非参数方法以及美式期权的非线性分析等内容。

《非线性自回归模型的非参数方法及应用》可作为高等院校统计学专业硕士研究生、博士研究生教材，也可供相关专业研究生、教师、科研人员和统计工作者参考。

作者简介

无

书籍目录

前言第1章 引论1.1 绪言1.2 国内外研究现状1.3 主要研究内容第2章 核估计的中心极限定理2.1 问题的提出及基本假设2.2 渐近正态性2.3 一个扩展2.4 数值模拟2.5 小结第3章 自助估计法3.1 研究现状及基本假设3.2 平稳自助估计法3.3 无序自助估计法3.4 自助估计的置信区域3.5 小结第4章 阶的误设效应4.1 非线性自回归过程的阶4.2 数值模拟4.3 线性自回归过程的阶4.4 小结第5章 欧式期权定价的非参数方法5.1 核密度估计及其大样本性质5.2 核密度估计在期权定价上的应用5.3 数值模拟5.4 不同期满日的期权定价5.5 小结第6章 美式期权定价非线性方法6.1 问题的提出6.2 美式期权价值的非线性偏微分方程6.3 基于最小二乘法的美式期权定价的最优停时分析6.4 美式期权定价中一类蒙特卡罗过程的收敛速率参考文献

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>