

<<非线性时间序列>>

图书基本信息

书名：<<非线性时间序列>>

13位ISBN编号：9787040173574

10位ISBN编号：7040173573

出版时间：2008-1

出版时间：高等教育出版社

作者：范剑青、姚琦伟、、陈敏

页数：408

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>

<<非线性时间序列>>

前言

众所周知，现实世界的运动规律往往是非线性的，事实上，在一个线性的世界里，量变永远都不能产生质变的，换言之，物理学的相变，生物学的细胞突变，经济学的收益递减等等都会消失于线性的世界里，可想而知，线性的世界是多么的乏味。

时间序列是探讨现实世界的运动规律的主要工具之一，近代统计学在廿世纪初刚出世的时候就已经包括了这个分支，可惜的是，和其它的分支一样，线性的模型长期地统治了整个时间序列的领域，长达半个世纪之久，在这漫长的岁月中，我们看到的主要是英国的u，Yule在1927年创建的回归模型和俄国的E，Slu

<<非线性时间序列>>

内容概要

本书主要介绍非线性时间序列理论和方法的一些最新研究成果，尤其以近十年来发展起来的非参数和半参数技术为主。本书不仅对这些技术在时间序列状态空间、频域和时域等方面的应用给出了详细的介绍，同时，为了体现参数和非参数方法在时间序列分析中的整合性，还系统地阐述了一些主要参数非线性时间序列模型（比如ARCH / GARCH模型和门限模型等）的近期研究成果。

此外，书中还包含了一个对线性ARMA模型的简洁介绍，为了说明如何运用非参数技术来揭示高维数据的局部结构，本书借助了很多源于实际问题的具体数据，并注重在这些例子的分析中体现部分的分析技巧和工具。

阅读本书只需要具备基础的概率论和统计学知识。

本书适用于统计专业的研究生、面向应用的时间序列分析人员以及该领域的各类研究人员。

此外，本书也对从事统计学的其他分支以及经济计量学、实证金融学、总体生物和生态学的研究人员有参考价值。

<<非线性时间序列>>

作者简介

范剑青，美国普林斯顿大学运筹与金融工程系、经济系讲座教授，统计研究会主任，1982年复旦大学毕业，1989年获得美国加州伯克利大学统计学博士，曾任美国加州大学洛杉矶分校教授，香港中文大学讲座教授、统计系主任，现还兼任英国伦敦经济学院教授、中国科学院数学与系统科学研究院国际统计研究中心主任是国际数理统计研究院、美国统计学会、美国科学发展学会等的Fellow担任著名杂志The Annals of Statistics、Probability Theory and Related Fields主编，Journal of American Statistical Association等副主编因发明非参数建模中局部多项式等方法，获得国际统计联席委员会的“2000 COPSS Presidents”奖因他在统计学的杰出贡献，被邀参加2006国际数学家大会的邀请报告。

姚琦伟，伦敦经济学院讲座教授，北京大学光华管理学院特聘教授，1982年毕业于东南大学，1987年获武汉大学统计学博士学位，现为IMS的Fellow、ISI的选举委员，已担任包括Journal of the Royal Statistical Society(Series B)，Annals of Statistics等多种杂志的副主编。

<<非线性时间序列>>

书籍目录

第一章 绪论第二章 时间序列的特征第三章 ARMA建模和预报第四章 参数非线性时间序列模型第五章 非参数密度估计第六章 时间序列的平滑第七章 谱密度估计及其应用第八章 非参数模型第九章 模型的确定第十章 非线性预报参考文献索引

<<非线性时间序列>>

编辑推荐

由姚琦伟、范剑青编写的《非线性时间序列——建模、预报及应用》是对当前时间序列数据分析技术的一次集中展现。

本书的最初目标是想对每一个主要的方法向读者提供一个比较完整的介绍，因此在写作时，本书尽量协调对方法、理论以及数值结果等部分的描述。

对于一个具体的时间序列模型，本书力图从定义、概率性质(如果可能的话)、统计推断方法以及应用于实际数据的数值结果等方面逐步展开，与此同时，本书也会向读者推荐一些我们自己比较喜欢的相关的计算机程序。

在实际例子的选择方面，本书尽量在众多的学科中寻求一种平衡。

本书不仅面向那些初次涉及该领域的人，同时也希望对那些已经熟悉该领域的专家有参考价值。

<<非线性时间序列>>

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>