

<<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：9787300167220

10位ISBN编号：7300167225

出版时间：2012-12

出版时间：中国人民大学出版社

作者：王燕

页数：265

字数：390000

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>>

前言

所谓时间序列就是按照时间的顺序记录的一列有序数据。

对时间序列进行观察、研究，找寻它变化发展的规律，预测它将来的走势就是时间序列分析。

在日常生产、生活中，时间序列比比皆是，时间序列分析的应用领域非常广泛。

作为数理统计学的一个分支，时间序列分析遵循数理统计学的基本原理，利用观察信息估计总体的性质。

但是由于时间的不可重复性，使得我们在任意一个时刻只能获得唯一的序列观察值，这种特殊的数据结构导致时间序列分析有其非常特殊、自成体系的一套分析方法。

目前，国内有关时间序列分析的著作和教材有很多，每本书都有特定的读者群体。

本书的定位是大学本科生的时间序列分析入门教材。

根据这个定位，本书语言通俗、案例丰富，理论联系实际紧密，习题难易程度适当，非常便于学生理解和练习。

随着计算机科学的高速发展，现在有许多软件可以帮助我们进行时间序列分析。

本书选择的应用软件是SAS。

在SAS系统中有一个专门进行计量经济与时间序列分析的模块：SAS/ETS (Econometric & Time Series)

。同时，由于SAS系统具有一流的数据仓库功能，因此在进行海量数据的时间序列分析时具有其他统计软件无可比拟的优势。

.....

<<应用时间序列分析>>

内容概要

《21世纪统计学系列教材：应用时间序列分析（第3版）》选择的应用软件是SAS。在SAS系统中有一个专门进行计量经济与时间序列分析的模块：SAS/ETS（Econometric & Time Series）。

同时，由于SAS系统具有一流的数据仓库功能，因此在进行海量数据的时间序列分析时具有其他统计软件无可比拟的优势。

为了帮助同学们在学习理论知识的同时熟练地掌握SAS / ETS软件的操作和分析技巧，《21世纪统计学系列教材：应用时间序列分析（第3版）》在每一章后面都有一小节的内容详细介绍本章的分析方法在SAS软件上的实现。

为使同学们更好地学习和操作，《21世纪统计学系列教材：应用时间序列分析（第3版）》所有例题的数据、习题数据、例题的操作程序及上机指导程序都放在人大经管在线，读者可免费下载。

为了便于教师上课，本书特别制作了课件（PPT）及简要的习题参考答案，教师可上人大经管在线下载使用。

<<应用时间序列分析>>

书籍目录

第1章 时间序列分析简介

1.1 引言

1.2 时间序列的定义

1.3 时间序列分析方法

1.3.1 描述性时序分析

1.3.2 统计时序分析

1.4 时间序列分析软件

1.5 习题

1.6 上机指导

1.6.1 SAS操作界面

1.6.2 创建时间序列SAS数据集

1.6.3 时间序列数据集的处理

第2章 时间序列的预处理

2.1 平稳性检验

2.1.1 特征统计量

2.1.2 平稳时间序列的定义

2.1.3 平稳时间序列的统计性质

2.1.4 平稳时间序列的意义

2.1.5 平稳性的检验

2.2 纯随机性检验

2.2.1 纯随机序列的定义

2.2.2 白噪声序列的性质

2.2.3 纯随机性检验

2.3 习题

2.4 上机指导

2.4.1 绘制时序图

2.4.2 平稳性与纯随机性检验

第3章 平稳时间序列分析

3.1 方法性工具

3.1.1 差分运算

3.1.2 延迟算子

3.1.3 线性差分方程

3.2 ARMA模型的性质

3.2.1 AR模型

3.2.2 MA模型

3.2.3 ARMA模型

3.3 平稳序列建模

3.3.1 建模步骤

3.3.2 样本自相关系数与偏自相关系数

3.3.3 模型识别

3.3.4 参数估计

3.3.5 模型检验

3.3.6 模型优化

3.4 序列预测

3.4.1 线性预测函数

<<应用时间序列分析>>

3.4.2 预测方差最小原则

3.4.3 线性最小方差预测的性质

3.4.4 修正预测

3.5 习题

3.6 上机指导

3.6.1 模型识别

3.6.2 参数估计

3.6.3 序列预测

第4章 非平稳序列的确定性分析

4.1 时间序列的分解

4.1.1 Wold分解定理

4.1.2 Cramer分解定理

4.2 确定性因素分解

4.3 趋势分析

4.3.1 趋势拟合法

.....

第5章 非平稳序列的随机分析

第6章 多元时间序列分析

附录1

附录2

附录3

参考文献

<<应用时间序列分析>>

编辑推荐

随着计算机科学的高速发展，现在有许多软件可以帮助我们进行时间序列分析。

苏世军、张养志主编的《西方出版产业管理》选择的应用软件是SAS。

在SAS系统中有一个专门进行计量经济与时间序列分析的模块：SAS / ETS(Econometric & Time Series)。同时，由于SAS系统具有一流的数据仓库功能，因此在进行海量数据的时间序列分析时具有其他统计软件无可比拟的优势。

<<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>