

<<时间序列X-12-ARIMA季节调整>>

图书基本信息

书名：<<时间序列X-12-ARIMA季节调整>>

13位ISBN编号：9787504941510

10位ISBN编号：7504941514

出版时间：2006-1

出版时间：中国金融出版社

作者：中国人民银行调查统计

页数：428

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X-12-ARIMA季节调整>>

内容概要

X-12-ARIMA方法最早由美国普查局Findley等人在20世纪90年代左右提出，现已成为对重要时间序列进行深入处理和分析的工具，也是处理最常用经济类指标的工具，在美国和加拿大被广泛使用。其在欧洲统计界也得到推荐，并在包括欧洲中央银行在内的欧洲内外的许多中央银行、统计部门和其他经济机构被广泛应用。

对时间序列X-12-ARIMA季节调整的原理进行研究并对其软件进行中国本地化是中国人民银行的科研项目，本书为上述科研成果之一。

<<时间序列X-12-ARIMA季节调整>>

书籍目录

第1章 时间序列(ARIMA和SARIMA)模型1.1随机过程、时间序列1.2时间序列模型的分类1.3自相关函数1.4偏自相关函数1.5时间序列(ARIMA)模型的建立与预测1.6非季节时间序列建模案例1.7季节时间序列(SARIMA)模型1.8季节时间序列建模案例第2章 时间序列的移动平均计算原理2.1定义和理论2.2X-11中的对称移动平均2.3Musgrave非对称移动平均2.4X-11移动平均滤子第3章 单位根检验方法3.1平稳与非平稳序列的统计特征3.2四种典型的非平稳随机序列3.3DF分布3.4单位根的DF检验用表3.5进一步讨论3.6单位根检验3.7单位根检验举例3.8结构突变与单位根检验第4章 x-12-ARIMA季节调整原理4.1季节调整的意义4.2X-12-ARIMA简介4.3x-12-ARIMA程序的基本流程4.4regARIMA建模原理4.5x-11的默认计算原型4.6x-11方法的具体步骤4.7x-12-ARIMA设定函数的运算流程4.8案例附录 AEVI : EWS的视窗菜单操作附录 BEVIEWS的命令行操作第5章 x-12-RIM季节调整程序中的新功能与方法5.1引言5.2新的X-11调整选项5.3新的诊断5.4I regARIMA建模与模型选择5.5用模型解决调整问题: 四个例子5.6用户交互界面: 三个例子5.7结论性评论附录 AHenderson滤子、Musgrave非对称滤子附录 BA0和Ls探测程序第6章 X-12输出结果详解前言6.1输出表格B部分: 初步估计极端值和日历效应6.2输出表格C部分: 极端值和日历效应的最终估计6.3输出表格D部分: 不同成分的最终估计6.4输出表格E部分6.5输出表格F部分: 季节调整质量的衡量第7章 中国春节等特殊日历因素调整方案7.1移动假日效应7.2春节模型7.3案例7.4存量数据的春节效应调整7.5genhol程序简要说明7.6春节模型的进一步改进7.7存量数据春节模型的进一步改进附表1 春节虚拟变量(流量数据)1970—2020年($w=20$)附表2 春节虚拟变量(存量数据)1970—2020年($w=31$)附表3 春节虚拟变量(存量数据)1970—2020年($w=25$)附表4 改进春节模型的春节虚拟变量(流量数据)附表5 改进春节模型的春节虚拟变量(存量数据)1970—2020年($w=15, wd=3, wa=20, w2=31$)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>