

# 《时间序列分析》

## 书籍信息

版次：1

页数：

字数：

印刷时间：2006年01月01日

开本：

纸张：胶版纸

包装：平装

是否套装：否

国际标准书号ISBN：9787810785679

## 内容简介

本书受对外经济贸易大学“211”项目资助，是子项目e11007的阶段性成果。本书人有如下特色：（1）内容齐全新颖，包括确定性时间序列分析，线性ARMA模型，波动率模型，向量自回归模型，单位根检验和协整，以及一些非线性模型，目前还没有一本中文教材包括所有这些内容；（2）强调如何对经济数据建立模型，使用大量经济时间序列为数据举例说明，有些例题从学术期刊摘取，介绍模型理论背景，使学生了解学术研究与所学方法的关系；（3）对于基本概念，一方面深入浅出，强调从直观的经济的角度来理解，另一方面要求学生从统计的角度理解概念；（4）每章都介绍使用Eviews软件的操作方法。

本书从建立经济模型的角度组织内容，基本要求是学会建模方法，其次要求理解为什么这样建模，然后能够看懂相关理论证明和从统计角度理解概念，知道证明思路，最后要求学生可以自己证明一些\*过程的基本性质。

## 目录

### 第1章 概率和统计基础

#### 1.1 概率基础

#### 1.2 假设检验

#### 1.3 描述统计

#### 习题1

#### Eviews入门

### 第2章 确定性时间序列模型

#### 2.1 时间序列的分解

#### 2.2 平滑方法

#### 2.3 拟合趋势

#### 2.4 趋势和季节调整

#### 习题2

#### Eviews操作：平滑方法和季节调整

### 第3章 平稳线性ARMA模型

#### 3.1 随机过程的基本概念

#### 3.2 几个重要的平稳随机过程

#### 3.3 建立线性ARMA模型

#### 3.4 预测

#### 3.5 具有趋势性的ARIMA模型

#### 3.6 季节时间序列模型

#### 习题3

#### Eviews操作：建立ARMA模型

### 第4章 波动率模型

- 4.1 波动率模型概述
- 4.2 自回归条件异方差模型
- 4.3 GARCH模型
- 4.4 非对称条件异方差模型
- 4.5 ARCH-M模型
- 4.6 其他GARCH类模型
- 4.7 向量条件异方差模型
- 4.8 随机波动率模型

习题2

Eviews操作：建立多维时间序列模型

## 第6章 非平稳时间序列模型

- 6.1 确定性趋势过程和单位根过程
- 6.2 单位根检验
- 6.3 协整过程性质
- 6.4 协整检验

习题6

Eviews操作：非平稳时间序列模型

## 第7章 非线性时间序列模型

- 7.1 非线性模型概述
- 7.2 三个非线性模型
- 7.3 非参数估计方法
- 7.4 非线性检验

参考文献

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www.tushupdf.com](http://www.tushupdf.com)