

1999年第四期(总第四期) 非平稳时间序列的状态空间建模与预测--路磊

非平稳时间序列的状态空间建模与预测--路磊

在GOOGLE搜索此内容

1999-10-1 阅读5822次

非平稳时间序列的状态空间建模与预测

路磊

(北京大学中国经济研究中心98 级博士)

一引言

随着随机过程、统计学等理论的发展, 时间序列分析方法得到了广泛的应用和发展, 其理论也逐渐成熟起来。其中Box 和Jenkins 的ARIMA 模型是近几年来国际上流行的一种时间序列预测模型, 但是由于ARIMA 方法计算复杂、繁琐, 着重于单纯从数据自身的相关特性来研究时间序列的各种性质, 而忽略了引发数据变化的原因, 所以在实际中未得到广泛应用。

相关下载:

文件下载1

相关信息:

没有相关信息

相关评论:

没有相关评论 [点这里发表评论](#)



发表、查看更多关于该信息的评论



打印本页

[| 北京大学](#) | [| 中心概况](#) | [| BIMBA](#) | [| CENET](#) | [| 联系方式](#) | [| 站点导航](#) | [| 繁体版](#) | [| ENGLISH VERSION](#) |

Copyright© 1998-2005 北京大学 中国经济研究中心 版权所有

保留所有权利, 未经允许请勿挪用, 有任何问题与建议请联络: webmaster@ccer.pku.edu.cn

京ICP备05005746