

论文

时间序列稳定协和性的数值分析

吕纯濂,陈舜华

南京信息工程大学数学系;南京信息工程大学应用气象系 南京 210044 南京金肯学院 南京 211156 ;南京 210044

摘要:

许多观测到的时间序列常显示出非平稳性.当时间序列的一阶差分为白噪声时,就产生了非平稳性的简单形式,在这种情况下,称该序列,比如说 $y_t$ 为一阶求和的,记为 $y_t - I(1)$ ,而对其一阶差分记为 $\Delta y_t - I(0)$ .在求和序列的统计分析中,重要的一步是实现 $I(1)$ 变量的线性组合使之成为 $I(0)$ 就可能实现了,此时称这些变量为协和的.

关键词:

NUMERICAL ANALYSIS TO STABLE COINTEGRATION FOR TIME SERIES

Lu Chunlian(Dept. of Mathematics of Nanjing University of Information Science & Technology, Nanjing 210044; Nanjing Jinken University, Nanjing 211156)Chen Shunhua(Dept. of Applied Meteorology of Nanjing University of Information Science & Technology, Nanjing 210044)

Abstract:

Cointegration analysis for time series involves the solution of a generalized eigenproblem involving moment matrices and inverted moment matrices. These formulae are unsuitable for actual computations because the condition numbers of the resulting matrices are unnecessarily increased. The special structure of the cointegration procedure is used to achieve numerically stable computations, based on QR and singular value decompositions.

Keywords:

收稿日期 修回日期 网络版发布日期

DOI:

基金项目:

通讯作者:

作者简介:

本刊中的类似文章

扩展功能

本文信息

Supporting info

PDF(275KB)

[HTML全文](0KB)

参考文献[PDF]

参考文献

服务与反馈

把本文推荐给朋友

加入我的书架

加入引用管理器

引用本文

Email Alert

文章反馈

浏览反馈信息

本文关键词相关文章

本文作者相关文章

PubMed