

双重时序模型矩估计的渐近性:1.样本自协方差(自相关)函数

卢祖帝

中国科学院系统科学研究所!北京,100080

收稿日期 修回日期 网络版发布日期 接受日期

摘要 双重时序模型自提出以来,特别是关于模型的概率性质(如平稳性,遍历性)已有许多讨论,但统计推断方面的文章还很少.作为[9, 10]工作的继续,本文及后续文章将讨论矩估计及其大样本性质.首先在本文中,基本的矩估计量(样本自协方差函数及样本自相关函数)的渐近性质对AR

关键词 [双重时序模型,AR-MA模型,样本自协方差](#) (

分类号

ASYMPTOTIC PROPERTIES OF MOMENT ESTIMATION FOR A DOUBLY STOCHASTIC MODEL:1.SAMPLE AUTOCOVARANCE (AUTOCORRELATION) FUNCTION

LU ZUDI

Institute of Systems Science, the Chinese Academy of Sciences, Beijing 100080)

Abstract Since Tjøstheim (1986) put forward the doubly stochastic model, there have been many works mainly on the probabilistic properties (e.g., stationarity and ergodicity),but has been very little on the statistical inference. In the present and subse

Key words [doubly stochastic time series model](#) [AR-MA model](#) [sample autocovariance \(autocorrelation\)](#)

DOI:

通讯作者

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF\(0KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)
- ▶ [复制索引](#)
- ▶ [Email Alert](#)
- ▶ [文章反馈](#)
- ▶ [浏览反馈信息](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含 “双重时序模型,AR-MA模型,样本自协方差” 的相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [卢祖帝](#)