

学术论文

不同类型识别变量的AR模型异常值探测的Bayes方法

张倩倩 归庆明 王延停

信息工程大学理学院

收稿日期 2011-5-23 修回日期 2011-9-17 网络版发布日期 2012-6-29 接受日期 2012-7-4

摘要 摘要: 本文讨论时间序列数据中异常值探测的Bayes方法。该方法针对AR模型引入不同类型的识别变量, 通过比较这些识别变量的后验概率值与事先给定的阈值来进行异常值定位; 基于Gibbs抽样算法, 提出了识别变量后验概率值的计算方法和异常值的估算方法; 进行了大量的试验和应用, 证明了该方法对于解决时间序列数据中在同一时刻或不同时刻出现加性异常值或革新异常值的探测问题, 是可行的和有效的。

关键词 [AR模型](#) [加性异常值](#) [革新异常值](#) [识别变量](#) [Bayes方法](#) [Gibbs抽样](#) [卫星钟差](#)

分类号

DOI:

对应的英文版文章: [20110316](#)

通讯作者:

张倩倩 归庆明 王延停 zhangqianqian0216@163.com

作者个人主页: 张倩倩 归庆明 王延停

扩展功能

本文信息

- ▶ [Supporting info](#)
- ▶ [PDF \(6873KB\)](#)
- ▶ [\[HTML全文\]\(0KB\)](#)
- ▶ [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](#)

相关信息

- ▶ [本刊中 包含“AR模型”的 相关文章](#)
- ▶ 本文作者相关文章
 - [张倩倩 归庆明 王延停](#)