

多元时间序列模型



[多元时间序列模型_下载链接1](#)

著者:[美] 帕特里克·T.布兰特, [美] 约翰·T.威廉姆斯 著, 辛济云 译

[多元时间序列模型_下载链接1](#)

标签

评论

可以的，比原版便宜多了

很好，推荐购买

多元时间序列模型 多元时间序列模型

比较金典的书，买了看看。。。

..购买方便，性价比高，快递神速

活动购买，性价比很高，就是封面有点脏。

书薄薄的，印刷好，内容也不错

非常价廉物美啊。凑字数是个辛苦活。

这个要感谢京东物流 做得非常好！

书不错哈，是正版的，纸张好

很好很好很好很好很好

这个系列的书都很不错

还不错的这次发票没开错

书非常不错啊，学习的好书，充电啊

本人购买了 格致方法 定量研究系列 这一套书 很不错的啊 建议购买啊
好书值得购买收藏和学习

不错不错不错不错不错不错不错不错

买的书很好的，子很舒服，内容很喜欢

正版图书的

值得购买

丰富一下知识

好的。

不错

序 第1章 前言 第2章 对多元时间序列模型的介绍 第1节 同时方程方法 第2节 自回归整合移动平均模型 第3节 误差纠正模型和伦敦经济学院方法 第4节 向量自回归 第5节 比较和总结 第3章 基本的向量自回归模型 第1节 动态结构方程模型 第2节 向量自回归的简化形式 第3节 向量自回归模型与动态同时方程模型的关系 第4节 模型的运用 第5节 向量自回归模型的设定与分析

《多元时间序列模型》一书中，作者讨论了五种主要的时间序列数据建模方法：自回归整合移动平均模型、同时方程模型、误差纠正模型和向量自回归模型，同时，本书还举出了向量自回归模型的两个实例，解释了如何使用这种模型。在本书的附录部分，作者讨论了如何选用适合时间序列分析的统计软件。

韩敏，朝鲜族，工学博士。大连理工大学教授，博士研究生导师，九三学社社员。兼任中国仪器仪表学会青年工作委员会副主任委员，辽宁省系统仿真学会理事，中国人工智能学会科普工作委员会委员。1978年考入大连理工大学（原大连工学院）电子系学习，1982年获得学士学位，通过在职学习于1992年在同校获得硕士学位。1992~1999年留学日本，在日本国立九州大学获得工学修士和博士学位。1999年学成回国到大连理工大学任教。主要从事智能控制理论及应用、混沌时间序列分析、复杂系统建模与预测等研究。得到教育部留学回国人员科研启动基金项目“具有多重分支的神经网络机理分析”，国家自然科学基金项目“含噪声混沌时间序列重构模型与预测研究（60374064）”，“基于多元时间序列分析的复杂系统建模与预测研究（60674073）”，以及国家重要基础研究发展计划“973”项目研究专题“黄河年径流量长期变化的混沌动力学分析（G1999043602）”等支持。在混沌系统分析及预测方面取得了丰富的成果，获省部级以上学术奖励两项。有关论文发表在《IEEE Trans, on Neural Networks》、《Neural Networks》、《IEEE Trfins, on Signal Processing》、《控制理论与应用》、《控制与决策》等杂志上，累计发表论文140余篇，其中SCI、EI检索论文40余篇。

本书从混沌学的基本概念出发介绍混沌信号噪声滤除方法，重点论述了具有混沌特性时间序列的预测方法。针对一些实际问题，给出了多个实际混沌系统预测研究的算例，希望能对感兴趣的读者有所帮助。

本书可以作为相关专业本科生、研究生以及研究人员的参考书，在内容上力求做到理论完整、推算翔实，在写作上力求做到深入浅出、通俗易懂，使其具有良好的可读性，以方便读者对书中内容的理解和应用。多元回归时间序列是指ARIMA模型下面研究的时间序列的回归问题。多因素时间序列一般是说同时考虑多个外生变量和内生变量的滞后项的问题，而ARIMA就是其中用于进行回归的一种方法，而且是最一般的方法。

[多元时间序列模型_下载链接1](#)

书评

[多元时间序列模型_下载链接1](#)