

<<商业和经济预测中的时间序列模型>>

图书基本信息

书名：<<商业和经济预测中的时间序列模型>>

13位ISBN编号：9787300044569

10位ISBN编号：7300044565

出版时间：2002-12

出版时间：中国人民大学出版社

作者：弗朗西斯

页数：324

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## &lt;&lt;商业和经济预测中的时间序列模型&gt;&gt;

## 前言

前言 经济与商业时间序列的计量分析是研究与应用的主要领域。最近几十年，无论是在理论上，还是实际应用上，人们对构建时间序列模型以及将其应用于预测的兴趣与日俱增。

在今天的时序应用中出现了许多新的方向，比如单位根、协整、GARCH模型、变季节性、异常观测值和非线性等。

尽管并不能够令人信服地表明在所有这些方向上都能得到更好的预测，但其中的许多方向还会存在下去，并成为今后十年中实际预测的工具之一。

本书的目的就是从对经济与商业时间序列的预测这个角度，来回顾这些方法的几个最新进展。

一本论及时间序列分析所有方面的全面的教科书将达数千页。

例如，就单位根分析而言，这一领域扩展的步伐与变化是如此之快，以至于仅论述这一主题，需要比本书更多的页数。

因此，本书不准备对时序分析的所有现存内容作全面的介绍。

很明显，作出这番选择必定要付出代价，也就是说，书中的许多讨论有时在理论上可能不如读者所希望的那样精确。

事实上，有时这些讨论是概括性的。

在这里，按照我的意图，读者应该能够依据那些已充分描述了数据的重要特征的时间序列模型来作出他们自己的预测，评估这些预测值，如果必要的话还要能够对模型可能的修正提出一些建议。

对一些有趣的案例，我也建议进一步的阅读。

为了达到这一目的，在所有构建与评估时间序列模型的方法之间，在所有的估计方法以及所有能够使用的各种不同的检验方法之间，我都作了选择。

基本上，我的选择也常常是受这些方法能否在这些统计软件，像MicroTSP7.0或Eviews2.0上使用所促动，当然，有时也需要一点Gauss或Matlab程序。

事实上，这本书中所有的经验结果都是这样获得的。

我作出选择的另一个动机是来自于我在商业与经济时间序列预测中的实践经验，这些经验也是基于对我们的计量经济学专业的本科生在银行、投资公司和咨询代理处实习期间的项目的监管。

毋庸多言，由于这些经验总是有限的，这本书不应该被认为是对其他方法的有用性的一个否定。

对于这本书，我的第二个意图是，读者将能够在一定程度上理解这些在最近或将来的期刊上出现的新方法。

这些期刊主要有时间序列分析杂志、计量经济学杂志、商业和经济统计学杂志、预测杂志、国际预测杂志、应用计量经济学杂志和美国统计协会杂志等。

希望读者在这本书中能够找到这些有助于理解为什么这些新方法对预测是有帮助的材料。

尽管本书充其量只不过是时序分析与预测这一领域的一个入门，读者有一些入门的计量经济学知识也是必须的，特别像回归分析、矩阵代数和估计中的许多概念都应该包括其中。

本书不仅对商业和经济专业的高年级本科生与研究生很有用，并且适用于那些只想对时间序列的预测获得一个初步，但又不是太技术性的印象的实际工作者和应用经济学家。

事实上，对书中的大部分材料，在1996和1997年秋季，我已经在鹿特丹计量经济学院为三年级本科生所开的时间序列分析课程中使用过。

学生们对本书的修改与更正提出了有用的建议。

我要特别感谢Olav Beruto, Peter Brouwer, Johan Duyvesteyn, Roy Kluitman和Erik Pennings。

本书是我在鹿特丹伊拉兹马斯(Erasmus)大学计量经济学院工作期间写的，这里的教学与研究环境很富有启发性。

在此我要向我的同事Dick van Dijk, Teun Kloek, Ander Lucus, Marius Ooms和一位匿名评审人为本书的某些或所有章节所作评论表示最衷心的感谢。

我还要特别感谢我的时间序列分析课的合作者Christiaan Heij老师，他非常认真地阅读了所有的章节并且提出了许多更正和改进的方法。

菲利普·汉斯·弗朗西斯 1998年1月于鹿特丹

## <<商业和经济预测中的时间序列模型>>

### 内容概要

经济理发师商业时间序列的计量分析是研究与应用的主要领域。

最近几十年，无论是在理论上，还是实际应用上，人们对构建时间序列模型以及将其应用于预测的兴趣与日俱增。

在今天的时序应用中出现了放多新的方向，比如单位根、协整、CARCH模型、变季节性、异常观测值和非线性等。

尽管并不能够令人信服地表明在所有这些方向上都能得到更好的预测，但其中的许多方向还会存在下去，并成为今后十年中实际预测的工具之一。

本书的目的就是从对经济与商业时间序列的预测这个角度，来回顾这些方法的几个最新进展。

书籍目录

第1章 引言与述评第2章 经济时间序列的重要特征2.1趋势2.2季节性2.3异常观测值2.4条件异方差2.5非线性2.6共同的特征第3章 单变量时间序列分析中的基本概念3.1自回归移动平均模型3.2自相关与模型识别3.3估计与诊断方法3.4模型选择3.5预测第4章 时间序列的趋势性4.1趋势建模4.2单位根检验4.3平稳性检验4.4预测第5章 季节性5.1季节时间序列的典型特征5.2季节单位根5.3周期模型5.4其他问题第6章 异常观测值6.1异常观测值的建模6.2异常观测值的检验6.3不规则数据与单位根第7章 条件异方差7.1条件异方差模型7.2模型确定与预测7.3模型的各种扩展第8章 非线性8.1一些非线性模型及其特征8.2实证研究中的模型确定策略.....

编辑推荐

一本论及时间序列分析所有方面的全面的教科书将达数千页。例如，就单位根分析而言，这一领域扩展的步伐与变化是如此之快，以至于仅论述这一主题，需要比本书更多的页数。因此，本书不准备对时序分析的所有现存内容作全面的介绍。很明显，作出这番选择必定要付出代价。

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>