

# 应用时间序列分析 2015 秋季

---

- 主讲老师: 席瑞斌
- 办公室: 数学中心全斋 23
- 助教: 武林杰、姜博川
- 课程主页: <http://www.math.pku.edu.cn/teachers/xirb/Courses/TimeSeries/TimeSeries2015.html>
- 电子邮件: ruibinxi AT math DOT pku DOT edu DOT cn  
wulinjie\_math AT pku.edu.cn (武林杰)  
jiangbochuan30871 AT 163.com (姜博川)
- 答疑时间: 待定
- 上课地点: 二教 411
- 上课时间: 周二: 3-4 节; 周五: 7-8 节 (单周)
- 教材: 何书元《应用时间序列分析》
- 讲授内容: 平稳序列, 平稳序列的谱函数, 自回归模型 (AR), 滑动平均模型 (MA), 自回归滑动平均模型 (ARMA), 均值和自协方差的估计, 时间序列预测, ARMA 模型的参数估计, 时间序列的谱估计
- 先修课程: 高等代数、概率论, 少量的泛函分析及复变函数知识
- 考试方式: 大作业+期末考试
- 成绩计算方式: 作业+大作业 (30-40%), 期末考试 (60%-70%)
- 参考书: P.J. Brockwell and R.A. Davis, Time Series: Theory and Methods. Springer  
J.D. Cryer and Kung-Sik Chan, Time Series Analysis with Applications in R, Springer  
G. Box, G. M. Jenkins and G. Reinsel, Time Series Analysis: Forecasting and Control, Wiley