

应用时间序列分析 2016 秋季

主讲老师:	席瑞斌
办公室:	数学中心全斋 23
助教:	武林杰、黄家盛
课程主页:	http://www.math.pku.edu.cn/teachers/xirb/Courses/TimeSeries/TimeSeries2016.html
电子邮件:	ruibinxi AT math DOT pku DOT edu DOT cn wulinjie_math AT pku.edu.cn (武林杰) monkey8856 AT sina.com (黄家盛)
答疑时间:	待定
上课地点	文史楼 219
上课时间:	周 1: 1-2 节; 周三: 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