

آنالیز

سری های زمانی

تألیف و تحقیق:
محمد جواد حیدری

حیدری، محمد جواد، ۱۳۳۹ -
آنالیز سری‌های زمانی / تألیف و تحقیق محمد جواد حیدری. - تهران:
کژال، ۱۳۸۳.
۱۱۴ ص. ISBN 964-95495-7-9: ۸۰۰۰ ریال.
فهرست‌نویسی براساس اطلاعات فیبا.
کتابنامه: ص ۷۶.
۱. تجزیه و تحلیل سریهای زمانی. الف. عنوان.
۵۱۹/۵۵
م ۸۳-۵۵۱۰
QA۲۸۰/ج ۹۸
کتابخانه ملی ایران

انتشارات کژال

نام کتاب : آنالیز سری‌های زمانی
انتشارات : کژال
تألیف و تحقیق : محمد جواد حیدری
نوبت چاپ : اول - ۱۳۸۴
قیمت : ۸۰۰۰ ریال
تیراژ : ۴۰۰۰ جلد
شابک : ۹۶۴-۹۵۴۹۵-۷-۹

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
۱۳	مقدمه
۱- تابع میانگین (mean function)، اتوکواریانس (auto covariance) تابع، خود	
۱۹	همبستگی (auto correlation function)
۲۰	۲- فرایند تصادفی مانا
۲۴	تمرینات

فصل دوم

۲۹	۱- فرایند MA (Moving Average)
۳۳	۲- سری زمانی اتورگرسیون (AUTOREGRESSIVE)
۳۸	۳- معادلات تفاضلی خطی همگن
۴۰	۴- سری‌های زمانی اتورگرسیون مرتبه دوم

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

۴۶	۵- نمایش متناوب فرایندهای MA , AR
۴۹	۶- سری‌های زمانی $ARMA$
۵۲	تمرینات

فصل سوم

۵۷	۱- پیش‌بینی مدل‌های AR
۶۰	۲- پیش‌بینی مدل‌های MA
۶۱	۳- پیش‌بینی مدل‌های $ARMA$
۶۳	تمرینات

فهرست مطالب

صفحه	عنوان
فصل چهارم	
۶۷	۱- برآورد توابع میانگین، کواریانس و خود همبستگی
۶۹	تمرینات
۷۰	۲- برآورد پارامترهای سری‌های زمانی
۷۳	فرایند MA
۷۶	فرایند ARMA
۷۸	تمرینات
۷۹	۳- تعیین مرتبه مدل
۸۱	تمرینات
۸۲	۴- تشخیص مدل: آنالیز مانده‌ها
۸۵	تمرینات

صفحه

فهرست مطالب

عنوان

فصل پنجم

۹۰ ۱- مدل‌های ARIMA

۹۵ تمرینات

فصل ششم

۱۰۲ چگالی طیفی

۱۰۵ دوره‌نما (The Periodogram)

۱۱۱ تمرینات

۱۱۲ منابع