



- 首页
- 期刊介绍
- 基本信息
- 编委会
- 编辑团队
- 期刊荣誉
- 收录一览
- 征稿简则
- 作者中心
- 编辑中心
- 订阅指南
- 联系我们
- English

吉首大学学报自然科学版 » 2006, Vol. 27 » Issue (4): 22-24 DOI:

数学 [最新目录](#) | [下期目录](#) | [过刊浏览](#) | [高级检索](#) [« Previous Articles](#) | [Next Articles »»](#)

时间序列趋势项的贝叶斯估计

(1.吉首大学数学与计算机科学学院, 湖南 吉首 416000; 2.吉首大学师范学院, 湖南 吉首 416000)

Bayesian Estimation of Time Series Model with Trend

(1.College of Mathematics and Computer Science, Jishou University,Jishou 416000, Hunan China;2.Normal College of Jishou University,Jishou 416000, Hunan China)

- 摘要
- 参考文献
- 相关文章

全文: [PDF \(1988 KB\)](#) [HTML \(1 KB\)](#) 输出: [BibTeX](#) | [EndNote \(RIS\)](#) [青景资料](#)

摘要 系统地分析了AR(p)误差项的时间序列模型的数学模型及条件似然函数, 并根据似然函数的统计结构构造了模型参数的共轭先验分布, 研究了正态-混合 Γ 先验下模型的贝叶斯推断理论, 包括趋势项的核估计参数及先验参数的后验分布的统计推断.

关键词: 贝叶斯估计 AR(p)误差 Gibbs抽样

Abstract: This paper systematically analyzes the mathematic model and conditional likelihood function of time series model with AR(p) error,and constructs conjugate prior distribution of parameters on the basis of the statistical structure of the function.In the condition of normal-mixed Γ prior distribution, the paper studies the Bayesian inference of the model,including the statistical inference of the parameter of the kernel estimation of trend and the prior parameters of posterior distribution.

Key words: Bayesian estimation AR(p) error Gibbs sampling

基金资助:
吉首大学校级科研项目(05JD046)

作者简介: 欧祖军(1979-),男,湖南省宜章县人,吉首大学数学与计算机科学学院讲师,硕士,主要从事概率统计研究.

引用本文:
欧祖军,李洪毅,罗先发. 时间序列趋势项的贝叶斯估计[J]. 吉首大学学报自然科学版, 2006, 27(4): 22-24.

OU Zu-Jun ,LI Hong-Yi,LUO Xian-Fa. Bayesian Estimation of Time Series Model with Trend[J]. Journal of Jishou University (Natural Sciences Edit, 2006, 27 (4): 22-24.

[1] 范金城,吴可法.统计推断导引 [M].北京:科学出版社,2001.
 [2] 高惠璇.统计计算 [M].北京:北京大学出版社, 1995.

没有找到本文相关文献

服务

- ▶ 把本文推荐给朋友
- ▶ 加入我的书架
- ▶ 加入引用管理器
- ▶ E-mail Alert
- ▶ RSS

作者相关文章

- ▶ 欧祖军
- ▶ 李洪毅
- ▶ 罗先发

版权所有 © 2012《吉首大学学报(自然科学版)》编辑部
通讯地址:湖南省吉首市人民南路120号《吉首大学学报》编辑部 邮编:416000
电话传真:0743-8563684 E-mail:xb8563684@163.com 办公QQ:1944107525
本系统由北京玛格泰克科技发展有限公司设计开发 技术支持:support@magtech.com.cn