

《时间序列分析》教学日历

2017-2018 学年第一学期

授课教师：杨鹏飞

学时：48 课时

序号	周次	日期	课时	教 学 内 容
1	5	9月26日	2	1.1 时间序列分析的一般问题； 1.2 时间序列分析的建立
2	5	9月28日	2	1.3 确定性时间序列分析概论； 1.4 随机时序分析的几个基本概念
3	6	10月3日	2	2.1 一阶自回归模型； 2.2 一般自回归模型
4	6	10月5日	2	2.3 移动平均模型； 2.4 自回归移动平均模型
5	7	10月10日	2	3.1 格林函数和平稳性
6	7	10月12日	2	3.2 逆函数和可逆性
7	8	10月17日	2	3.3 自协方差函数
8	8	10月19日	2	3.4 自谱
9	9	10月24日	2	4.1 模型识别；
10	9	10月26日	2	4.2 模型定阶； 4.3 模型参数估计
11	10	10月31日	2	4.3 模型参数估计(续)； 4.4 模型适应性检验
12	10	11月2日	2	4.5 Pandit-Wu 建模方法； 4.6 建模实例
13	11	11月7日	2	5.1 条件期望预测
14	11	11月9日	2	5.2 预测的三种形式； 5.3 预测值的适时修正
15	12	11月14日	2	6.1 趋势性时间序列的重要特征； 6.2 随机时间序列的趋势性检验
16	12	11月16日	2	6.3 平稳化方法； 6.4 趋势模型
17	13	11月21日	2	7.1 季节时间序列的重要特征
18	13	11月23日	2	7.2 季节性时间序列模型
19	14	11月28日	2	7.3 季节性检验； 7.4 季节时间序列模型的建立
20	14	11月30日	2	8.1 条件异方差模型； 8.2 条件异方差模型的建立
21	15	12月5日	2	8.3 几种扩展模型； 9.1 模型简介
22	15	12月7日	2	9.2 传递函数模型的识别； 9.3 传递函数的拟合与检验
23	16	12月12日	2	9.4 干预模型； 10.1 含异常值的 ARIMA 模型
24	16	12月14日	2	10.2 异常值的检测； 10.3 异常值分析的实例