

K-5/100

数理解析研究所講究録 312

り
8
2

時系列における統計的推定論の研究



京都大学数理解析研究所

1977年11月

ま え び き

これは 1977年 9月8日-10日の間 京都大学数理解
析研究所で行われた 研究集会

時系列における統計的推定論の研究

において報告された論文を、よくよくの著者の書き改めたそ
うである。ここに同研究集会において報告された論文がす
べて収録されている。

研究代表者として 研究集会が成功を収め、また報告書の
原稿が速かに寄せられたことに対して、参加された各位に感
謝したい。またこの集会に関して、いろいろお世話頂いた
数理解析研究所の方々にもお礼を申し上げます。

1977年 10月

竹 内 浩

京 都 大 学

2514603

図 書

数理解析研究所

時系列における統計的推定論の研究

研究会報告集

研究代表者 竹内 啓

1977年9月8日～9月10日

目 次

1. スペクトラム解析のある一般化 1
阪大 基礎工 谷口 正信
2. 定常過程における自己相関係数の領域 13
中塚 利直
3. 定常点過程の統計的漸近理論 24
統数研 尾形 良彦
4. Self-Exciting 点過程モデルの最尤推定 44
統数研 尾崎 統
5. Parameter estimation of a linear process 59 ✓
東工大 理 柴田 里程
6. 最小二乗法によるARI過程のパラメータ推定 78
慶応大 エ 川島 弘尚
7. On an ARIMA process 91 ✓
東工大 理 藤井 光昭
矢島 美寛

8. 時系列推定におけるSecond Order Asymptotic Efficiency / 09
 東大 経 竹内 啓
 電通大 赤平 昌文
9. 時系列推定における高次の漸近有効性について... / 15
 東大 経 竹内 啓
10. On some conditions for weak and strong consistency of
 Simple Least Squares Estimators for regression parameters
 and strong consistency of an estimator for spectral density
 function. / 25
 慶応大 エ 豊岡 康行
11. The generalized least-square estimate of autoregressive
 coefficients / 37
 東北大 経 細谷 雄三
12. 定常過程の近似としての自己回帰モデル..... / 44
 統数研 尾形 良彦
13. コレログラムの或る簡便推定量について..... / 61
 東理大 理 岩瀬 晃盛
14. PARAMETER ESTIMATION OF MARKOV RANDOM FIELDS..... / 73
 東大 理 H. Künsch