

K-5102
り 8.2

数理解析研究所講究録 312

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

リ
8
2

ま　　と　　が　　き

これは 1977年 9月 8日—10日、間 京都大学数理解析研究所で行われた 研究集会

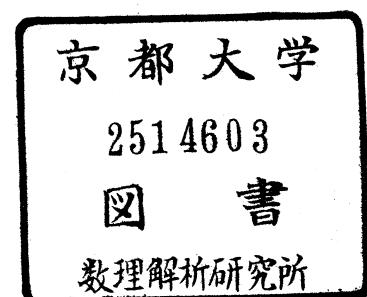
時系列における統計的推定論の研究

について報告された論文を、それらの著者が書き改めたものである。ここには同研究集会において報告された論文などを収録されている。

研究代表者として 研究集会が成功を収め、多くの報告者が原稿が速い返答をされたことに対して、参加された各位に感謝したい。またこの集会を開いて、いつもお世話を頂いた数理解析研究所の方々にもお礼と申上げたい。

1977年 10月

竹内啓



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

中塙 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ARIMA過程のパラメータ推定 78

慶應大 工 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 109
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

- 慶應大 工 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
統教研 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