

K-5100

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

ま え が 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、よめよめの著者の背を改めたそ  
のである。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