

P O V Z E T E K

V delu obravnavamo model časovne vrste, ki ima periodični značaj. Osnovna usmeritev časovne vrste, imenovana trend, je torej periodična.

V uvodu se srečamo z osnovnimi pojmi iz teorije časovnih vrst. Prvo poglavje je namenjeno obravnavi splošnega linearnega modela, kamor lahko vključujemo časovne vrste, ko so vzorčne spremenljivke linearne funkcije parametrov. Podrobneje se seznanimo z metodo najmanjših kvadratov, ki je ugodna za splošen model, ko porazdelitev ni znana.

Osrednji del je drugo poglavje, v katerem se ukvarjamo s cikličnimi trendi, ko periode delijo dolžino časovne vrste. V prvem delu je točkasto in intervalsko ocenjevanje, v drugem pa testiranje hipotez in problem mnogoterne odločitve med parametri.

Nazadnje nakažemo še problem ocenjevanja, ko perioda trenda ne deli dolžine časovne vrste.

L I T E R A T U R A

1. Anderson, The Statistical Analysis of Time Series
John Wiley and Sons
New York 1971
2. Box and Jenkins, Time Series Analysis Forecasting and
Control
Holden Day
San Francisco 1970
3. Graybill and Mood, Introduction to the Teory of
Statistics
McGraw - Hill
New York 1963
4. Jamnik, Uvod v matematično statistiko
Društvo matematikov, fizikov in astronomov
SR Slovenije
Ljubljana 1976
5. Lehmann, Testing Statistical Hypotheses
John Wiley and Sons
New York 1959
6. Plackett, Principles of Regression Analysis
Oxford Books of Mathematics
Oxford 1960