

# 2021 年度統計数理研究所公開講座

オンライン

## 「R による時系列解析入門」

川崎 能典講師

10 月 22(金)	10:00~12:20	<ol style="list-style-type: none"><li>1. 定常性とデータの変換</li><li>2. 自己共分散関数とスペクトル</li><li>3. 最小二乗法とモデル選択</li><li>4. ARMA モデルの性質</li></ol>
	13:20~17:00	<ol style="list-style-type: none"><li>5. ARMA モデルの推定</li><li>6. 季節 ARIMA モデル：識別と推定</li><li>7. 見せかけの回帰と単位根検定</li><li>8. 多変量自己回帰モデル</li></ol>