

平成 27 年度統計数理研究所公開講座

「非定常時系列解析」

川崎能典 講師†, 姜興起 講師‡

6 月 11 日(木)	10:00～11:00	定常時系列モデル†
	11:00～12:00	時系列の変換とモデリング†
	13:00～14:15	状態空間モデル‡
	14:15～15:15	トレンド推定と季節調整‡
	15:15～16:00	循環変動を含む時系列の季節調整‡
6 月 12 日(金)	10:00～11:00	TIMSAC for R パッケージ†
	11:00～12:00	説明変数・干渉変数の導入†
	13:00～13:45	時変係数 AR モデル‡
	13:45～15:00	ベイズ型線形モデル‡
	15:00～16:00	多変量状態空間モデル†