

計量時系列分析 FH22 061 / K62 1601	
第 2 学期 火曜 5, 6 時限 (2 単位)	対象 : 2~4 年生
担当教員 : 庄司 功 3F1226 電話 853-5094 E-mail shoji@sk.tsukuba.ac.jp Office hour メールでアポイントを取ること	
教科書 : 教科書は特に指定しないが、以下を参考書として挙げる。 <ul style="list-style-type: none"> • Box, G. P. and G. M. Jenkins, 1994, Time Series Analysis: Forecasting and Control, Prentice-Hall. • Pindyck, R. S. and D. L. Rubinfeld, 1991, Econometric Models and Economic Forecasts (3rd ed), Magraw-Hill. 	
授業概要・教育目標 : 標準的な時系列モデルを対象に、その理論的な性質を学び、同時に、データ解析を通じてこれらの適用方法を習得する。	

授業計画 :	
第 1 週	時系列解析とは
第 2 週	線形差分方程式
第 3 週	時系列データ生成と各種統計量の計算
第 4 週	定常時系列
第 5 週	AR モデルの自己共分散・自己相関係数
第 6 週	MA モデルの自己共分散・自己相関係数
第 7 週	偏自己相関係数
第 8 週	ARMA モデルと非定常 ARMA モデル
第 9 週	モデルの推定方法
第 10 週	予測値の計算方法

成績評価 : 宿題またはテストの評点に基づいて評価する。
備考 :