

L13 自己回帰モデル AR(m) ほか

樋口さぶろお

龍谷大学 先端理工学部 数理・情報科学課程

理論物理学特論 L13(2022-01-11 Tue)

最終更新: Time-stamp: "2021-12-24 Fri 09:39 JST hig"

今日の目標

- $AR(m)$, $ARMA(m)$ モデルが説明できる
- $AR(m)$, $ARMA(m)$ モデルをシミュレートできる



L12-Q1

Quiz 解答:移動平均

実は問題の $x(t)$ はこうやって作ってました. 周期が4だから, 4次の移動平均でだいたい回復できるでしょ.

t	0	1	2	3	4	5	6	7	8	
トレンド	0.0	0.2	0.4	0.6	0.8	1.0	1.2	1.4	1.6	
周期	2.0	-2.0	2.0	-2.0	2.0	-2.0	2.0	-2.0	2.0	-
ノイズ	-0.2	0.2	0.2	0.2	0.2	-0.2	0.2	-0.2	0.2	
x	1.8	-1.6	2.6	-1.2	3.0	-1.2	3.4	-0.8	3.8	
y_3		0.9	-0.1	1.5	0.2	1.7	0.5	2.1	1.0	
y_4			0.0	0.8	0.9	1.1	1.2	1.5		

L12-Q2

Quiz 解答:コレログラム