

試験問題骨子

持ち込み可能物件：

教科書（書き込み可、メモ等貼り付け可<メモ等挟み込み不可>）、電卓

ARIMA 問題。

数問、AC、PAC のグラフから $ARMA(p,q)$ の p,q を答えさせる問題がでます。理由も聞きます。

Box-Pierce と Ljung-Box の検定統計量を実際に計算して、自己相関係数が 0 という帰無仮説を検定する問題。

対数差分系列の意味

標本自己相関係数を求める回帰式と標本偏自己相関係数を求める回帰式

回帰分析の基本に関する復習問題（決定係数、信頼区間、検定）

信頼区間を使った検定のやり方