

クレジット:

UTokyo Online Education 数理手法Ⅶ 2019 北川源四郎

ライセンス:

利用者は、本講義資料を、教育的な目的に限ってページ単位で利用することができます。特に記載のない限り、本講義資料はページ単位でクリエイティブ・コモンズ 表示-非営利-改変禁止 ライセンスの下に提供されています。

<http://creativecommons.org/licenses/by-nc-nd/4.0/>

本講義資料内には、東京大学が第三者より許諾を得て利用している画像等や、各種ライセンスによって提供されている画像等が含まれています。個々の画像等を本講義資料から切り離して利用することはできません。個々の画像等の利用については、それぞれの権利者の定めるところに従ってください。



R_code(10)_2019.txt

```
#####  
# 第12章 季節調整モデル  
#####  
# BLSALLFOOD data の読み込み  
data(BLSALLFOOD)  
  
par(mar=c(2,2,3,1)+0.1) # 描画時の外枠の大きさ指定  
#  
# 標準的季節調整  
season(BLSALLFOOD, trend.order = 2, seasonal.order = 1)  
  
# AR(2)成分つきの季節調整  
season(BLSALLFOOD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 2)  
# 長期予測 (n=132まででモデル推定, n=133,...,156を予測)  
  
season(BLSALLFOOD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 0, filter = c(1,  
132))  
#  
season(BLSALLFOOD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 2, filter = c(1,  
132))  
  
#  
### timsacパッケージの関数 decompを使う場合 ###  
data(Blsallfood)  
z <- decomp(Blsallfood, trade = TRUE, year = 1973)  
z$aic  
z$lkhd  
z$sigma2  
z$tau1  
z$tau2  
z$tau3  
  
#####  
# Wholesale hardware data  
data(WHARD)  
#  
# 標準的着せr調整  
season(WHARD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 0,  
log = TRUE)  
#  
# 曜日調整  
season(WHARD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 0, trade = TRUE, log =
```

R_code(10)_2019.txt

TRUE)

長期予測 (n=132まででモデル推定, n=133,...,155を予測)

```
season(WHARD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 0,  
       filter = c(1, 132), log = TRUE)
```

```
season(WHARD, trend.order = 2, seasonal.order = 1, ar.order = 0, trade = TRUE,  
       filter = c(1, 132), log = TRUE)
```