

時系列モデリングとサロゲート法

中村知道

ソニーコンピュータサイエンス研究所

Abstract

我々の周りは、時間とともに変化する様々な現象で満ち溢れています。それらの現象を調べたり理解しようと思ったとき、その対象やシステムを、直接手に取って調べることが出来ないことがあります。しかし、そのような場合でも、観測によって時系列データを測定出来ることは多々あります。このようなとき、時系列データが現象を調べるための唯一の手掛かりになります。今回は時系列データから、データの性質を調べる方法とモデルを構築する方法について紹介します。

