

## 補章 時系列モデル入門

1. 時系列モデル分析の例

ARIMA のデータについて、時系列モデル分析をおこなってみる。次のプログラムを入力し、実行してみよう。(ファイル名は **ARIMA.tsp** としておく)

```
freq a;
smp1 1960 1992;
read(file='h:ARIMA.xls');
?
? 利率の分析
?
plot r;
bjident r;
bjest(nar=1,nma=0,const) r; ?AR(1)モデル
?
? GDP の分析
?
plot gdp;
bjident GDP;
bjident(NDIFF=1) GDP;
bjest(nar=1,ndiff=1,nma=0,const) GDP;
end;
```