

Emner i Tidsrækkeanalyse til og med kursusgang 5

1. Stationaritet
 - Streng stationaritet
 - Svag stationaritet (kovariansstationaritet)
2. Procestyper:
 - Hvid støj
 - MA
 - AR
 - Random Walk
3. Autokorrelationsfunktionen (Autokovariansfunktionen) - Teoretisk og Empirisk
4. Back-shift operatoren B
 - Det autoregressive polynomium
 - Det moving average polynomium
 - Differensoperatoren $\nabla = 1 - B$
5. Stationaritet og Kausalitet
6. Invertibilitet
7. ARMA
 - Beregning af ψ -koefficienter ved $MA(\infty)$
 - Beregning af π -koefficienter ved $AR(\infty)$
8. Differensligninger
9. "Almindelige" og Partielle autokorrelationer
10. Forecast som betinget middelværdi
11. Estimation
12. Diagnostiske tests (modelkontrol)
 - Residualanalyse
13. Tidsrækkemodellering
 - Identifikation
 - ACF, PACF, AIC BIC
 - Estimation
 - Modelkontrol

- Evt. forecast

14. ARIMA

15. Sæson