

## Chapter. 01

시계열 소개

# I 강의소개

FASTCAMPUS

ONLINE

금융공학/퀀트 I

강사. 김경륜

## 강사소개

- 現)글로벌IT사 데이터과학자 & 빅데이터솔루션사업담당이사
- 비바리퍼블리카(Toss) 데이터과학자
- 삼성SDS 수석데이터과학자
- 산업은행 리스크관리부 (바젤II,III)리스크모형/BIS비율산출/위기상황분석 검증담당
- 삼성카드 리스크관리실 리스크측정, 신용평가모형구축 및 운영담당
- Texas A&M 통계학박사
  
- 패스트캠퍼스 : R을 이용한 시계열예측 (2017~2018)
- 삼성SDS : 데이터과학자 양성과정 (2015~2017)  
머신러닝과정 (2015~2017)
- 삼성카드 : R교육과정 (2006~2007)
- 국내대학 및 기업대상 빅데이터 및 데이터사이언스 세미나 진행

## 강의내용

### 시계열예측 with R

#### 1. 시계열예측방법론

- 분해법
- ARIMA, 시계열회귀분석
- 신경망시계열 등

#### 2. R에서의 시계열분석

- ts 데이터
- R 시계열패키지 및 함수(forecast, prophet, ...)

## 강의내용

### 시계열예측 with R

#### 3. 예측모형구현 및 검증방법

- 시계열예측 모델링셋 및 테스트셋
- 모형성능측정(MAPE)

#### 4. 분석 및 예측실습

- R 함수를 이용한 예측모형구현