

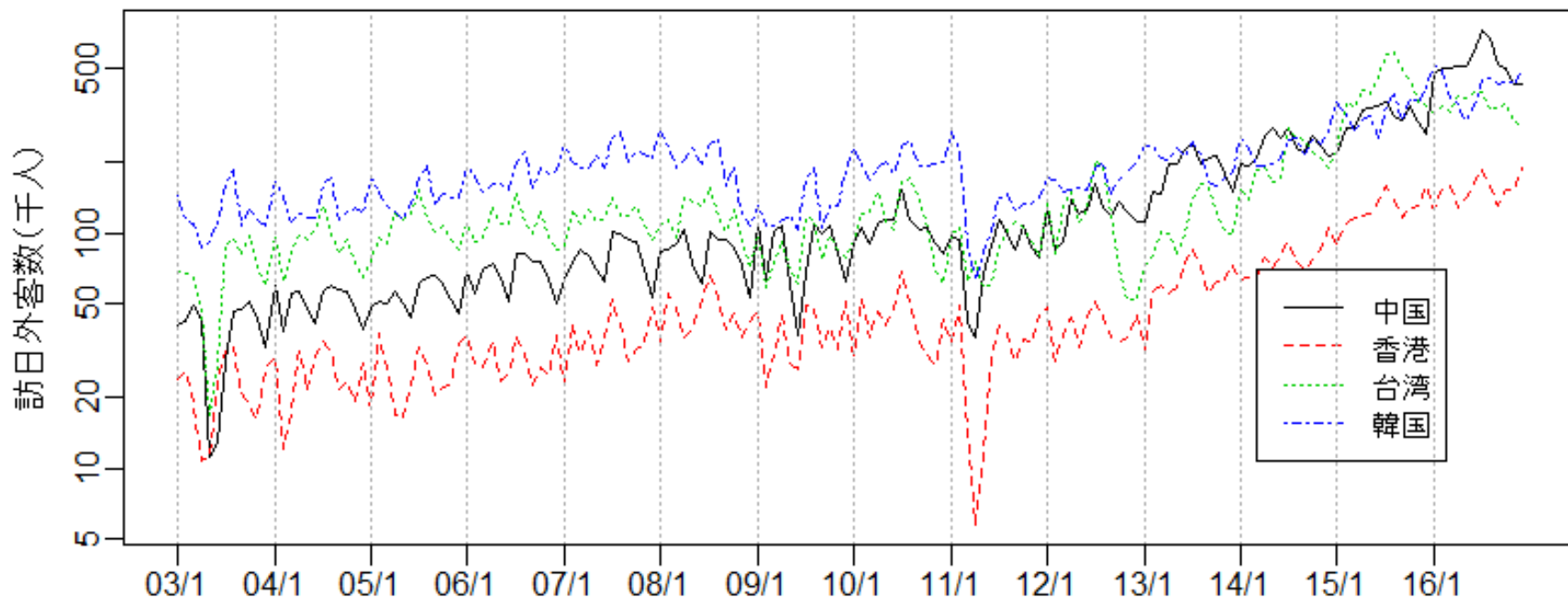
LB1-課題説明

野村俊一
統計数理研究所

テーマ: 訪日外客数の分析と予測

- ◆ JNTO(日本政府観光局)より国別の訪日外客数の月次推移データについて、状態空間モデルを用いて増減分析 & 将来予測をしましょう
- ◆ データは下記URLから取得してください

<https://sites.google.com/site/shunichinomu/datkadai>



課題

- ◆ 訪日外客数の月次推移(国は自由選択)について、以下の分析を行い、レポート(形式自由)にまとめて提出してください
- 1. 基本構造時系列モデルを適用し、最も当てはまりの良いトレンド成分モデル＋季節成分モデルの組合せをAICで選択しましょう
- 2. カレンダー効果(曜日効果、閏年効果など)も導入し、上のモデルとの違いを確認しましょう
- 3. 残差分析を行い、異常値を検出し、対処しましょう
- 4. 2017年1～12月の推移を予測しましょう
(数値を記入してください、講評時答え合わせします)