

האוניברסיטה העברית בירושלים
המחלקה לסטטיסטיקה

52640 – ניתוח סדרות עתיות
מרצה: פרופ' בנימין יקיר

1. **כללי:** הקורס מורכב מ 3 שעות הרצאה ובמהלכו יינתנו תרגילים לעבודה עצמית. כל תרגיל שהושקע מאמץ בפתרונו יזכה ב-3 נקודות. בסוף הקורס יתקיים מבחן. הציון הסופי יורכב מסך הנקודות שנצברו בתרגיל ומציון המבחן (מתוך הנקודות הנותרות), בתנאי שציון המבחן הוא לפחות 60.

2. **נושאי הקורס:**

סטטיסטיקה תיאורית בסדרות עתיות

סטטיסטיקה היסקית בסדרות עתיות: מודלים, ARMA, מודלים של מצב מרחב

נושאים נבחרים במרחב התדירויות – השימוש בפריודוגרם והצפיפות הספקטרלית

3. **ספרות עזר:**

A First Course on Time Series Analysis, Chair of Statistics University of Wuerzburg.
(<http://statistik.mathematik.uni-wuerzburg.de/timeseries/>)

שעות קבלה

בני יקיר: יום שני 15:00-16:00, חדר 4415
מספר טלפון: 052-3881255 אמייל: msby@mssc.huji.ac.il