

時系列分析と状態空間モデルの基礎 第1、2刷

正誤表

■p49 : 18~20 行目

誤

y_{t-2} も同様に、 $\phi_1 y_{t-3} + \varepsilon_{t-3}$ で表現できるため、式(2-22)は最終的に以下のように表現されます。

$$y_t = \phi_1^m y_{t-m} + \sum_{i=1}^m \phi_1^i \varepsilon_{t-i} + \varepsilon_t \quad (2-25)$$

正

y_{t-2} も同様に、 $\phi_1 y_{t-3} + \varepsilon_{t-2}$ で表現できるため、式(2-22)は最終的に以下のように表現されます。

$$y_t = \phi_1^m y_{t-m} + \sum_{i=1}^{m-1} \phi_1^i \varepsilon_{t-i} + \varepsilon_t \quad (2-25)$$

時系列分析と状態空間モデルの基礎 第3、4、5刷

正誤表

■p289 : 12~13行目

誤

$P(\theta = \text{女性} | y = \text{赤鞆発見})$ といった確率を「条件付確率」と呼びます。「赤鞆を持っているという条件で、その人が女性である確率」と解釈します。

正

$P(y = \text{赤鞆所持} | \theta = \text{女性})$ といった確率を「条件付確率」と呼びます。「女性という条件で、その人が赤鞆を持つ確率」と解釈します。

時系列分析と状態空間モデルの基礎 第6、7刷

正誤表

■p29：下から1～2行目

誤

なお、 k 次の偏自己相関は $k-1$ 時点までの影響が取り除かれた自己相関として解釈できません。

正

なお、 k 次の偏自己相関は $t-(k-1)$ 時点までの影響が取り除かれた自己相関として解釈できます。