

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。

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