

Tidsserier och sekvensinläring

Time Series and Sequence Learning

6 hp

Fristående- och programkurs

732A80

Gäller från: 2020 HT

Fastställd av	Huvudområde	
Filosofiska fakultetens nämnd för kurs- och utbildningsplaner	Statistik	
Fastställandedatum	Utbildningsnivå	Fördjupningsnivå
2020-05-11	Avancerad nivå	A1N
Reviderad av	Utbildningsområde	
	Tekniska området	
Revideringsdatum	Ämnesgrupp	
	Statistik	
Gavs första gången	Gavs sista gången	
2020		
Institution	Ersätts av	
Institutionen för datavetenskap		

Kursen ges för

- Master's Programme in Statistics and Machine Learning

Förkunskapskrav

- 180 hp avslutade kurser varav 90 hp inom något av följande ämnen:
 - statistik
 - matematik
 - tillämpad matematik
 - datavetenskap
 - teknik
- Godkända kurser i:
 - matematisk analys
 - linjär algebra
 - statistik
 - programmering
- Engelska 6
Undantag ges för svenska

Lärandemål

Efter avslutad kurs ska den studerande på en avancerad nivå kunna:

- tillämpa metoder för analys av sekventiell data
- redogöra för principer för urval, skattning och validering av sekventiella modeller
- använda statistisk och numerisk mjukvara för att anpassa tidsseriemodeller
- beräkna och analysera inferens om tidsseriekomponenter, prognoser och prognosernas statistiska osäkerhet
- utvärdera generaliseringsförmåga av statistiska samband för att göra prognoser

Kursinnehåll

I kursen behandlas aktuella metoder som behövs för ett professionellt arbete där sekventiella data undersöks, modifieras, modelleras och utvärderas.

I kursen ingår:

- Linjära autoregressiva modeller
- Icke-linjära autoregressiva modeller, inklusive temporala faltningsnätverk
- Tillståndsmoeller, Kalmanfiltrering och glättning
- Icke-linjära tillståndsmoeller och sekventiella Monte Carlo-metoder
- Återkopplade neurala nätverk
- Modellsfattning, modellvalidering och prediktion

Undervisnings- och arbetsformer

Undervisningen består av föreläsningar, lektioner och datorövningar. Utöver detta ska den studerande utöva självstudier.

Examinations- och undervisningsspråk: engelska

Examination

Examination sker genom:

- skriftlig redovisning av laborationsuppgifter, betygsskala: EC
- individuell skriftlig tentamen, betygsskala: EC

För godkänt slutbetyg krävs betyg Pass på laborationsdelen samt minst E på den individuella skriftliga tentamen. Slutbetyget grundas på betyget i den individuella skriftliga tentamen.

Detaljerad information återfinns i studieanvisningen.

Om det finns särskilda skäl, och om det med hänsyn till det obligatoriska momentets karaktär är möjligt, får examinator besluta att ersätta det obligatoriska momentet med en annan likvärdig uppgift.

Om LiU: s koordinator för studenter med funktionsnedsättning har beviljat en student rätt till anpassad examination vid salstentamen har studenten rätt till det.

Om koordinatören har gett studenten en rekommendation om anpassad examination eller alternativ examinationsform, får examinator besluta om detta om examinator bedömer det möjligt utifrån kursens mål.

Examinator får också besluta om anpassad examination eller alternativ examinationsform om examinator bedömer att det finns synnerliga skäl och examinator bedömer det möjligt utifrån kursens mål.

Studerande, vars examination underkänts två gånger på kursen eller del av kursen, har rätt att begära en annan examinator vid förnyat examinationstillfälle.

Den som godkänts i prov får ej delta i förnyat prov för högre betyg.

Betygsskala

ECTS, EC

Övrig information

Planering och genomförande av kurs ska utgå från kursplanens formuleringar. Den kursvärdering som ska ingå i varje kurs ska därför behandla frågan om hur kursen överensstämmer med kursplanen.

Kursen bedrivs på ett sådant sätt att både mäns och kvinnors erfarenhet och kunskaper synliggörs och utvecklas.

Om det föreligger synnerliga skäl får rektor i särskilt beslut ange förutsättningarna för, och delegera rätten att besluta om, tillfälliga avsteg från denna kursplan.