

Az idősorelemzés alapjai

Ferenci Tamás
tamas.ferenci@medstat.hu

Utoljára frissítve: 2023. május 12.

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősoelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősoelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősoelemzési iskolák, a módszerek felosztása

- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősorelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősorelemzési iskolák, a módszerek felosztása
- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősorelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősorelemzési iskolák, a módszerek felosztása
- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Idősor sokaságban és mintában I.

- Mi a sokaság és a minta? – ismétlés stat 2-ből
- („Sokaságban valszám kell, mintánál statisztika”)
- **Idősor** minta értelemben: időben rendezett megfigyelések

$$\{5492, 5640, \dots, 7317\},$$

általános jelöléssel

$$\{y_1, y_2, \dots, y_T\}$$

- Az egyetlen eltérés a keresztmetszethez képest: *sorrendjük* van (hatalmas jelentősége lesz majd)

Idősor sokaságban és mintában I.

- Mi a sokaság és a minta? – ismétlés stat 2-ből
- („Sokaságban valszám kell, mintánál statisztika”)
- **Idősor** minta értelemben: időben rendezett megfigyelések

$$\{5492, 5640, \dots, 7317\},$$

általános jelöléssel

$$\{y_1, y_2, \dots, y_T\}$$

- Az egyetlen eltérés a keresztmetszethez képest: *sorrendjük* van (hatalmas jelentősége lesz majd)

Idősor sokaságban és mintában I.

- Mi a sokaság és a minta? – ismétlés stat 2-ből
- („Sokaságban valszám kell, mintánál statisztika”)
- **Idősor** minta értelemben: időben rendezett megfigyelések

$$\{5492, 5640, \dots, 7317\},$$

általános jelöléssel

$$\{y_1, y_2, \dots, y_T\}$$

- Az egyetlen eltérés a keresztmetszethez képest: *sorrendjük* van (hatalmas jelentősége lesz majd)

Idősor sokaságban és mintában I.

- Mi a sokaság és a minta? – ismétlés stat 2-ből
- („Sokaságban valszám kell, mintánál statisztika”)
- **Idősor** minta értelemben: időben rendezett megfigyelések

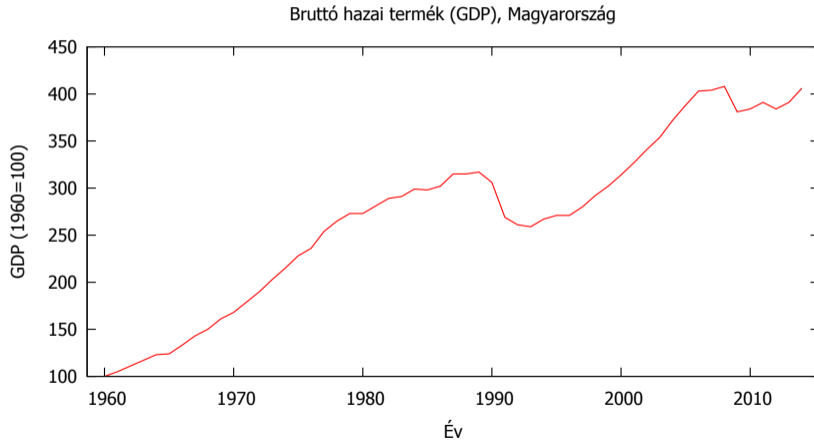
$$\{5492, 5640, \dots, 7317\},$$

általános jelöléssel

$$\{y_1, y_2, \dots, y_T\}$$

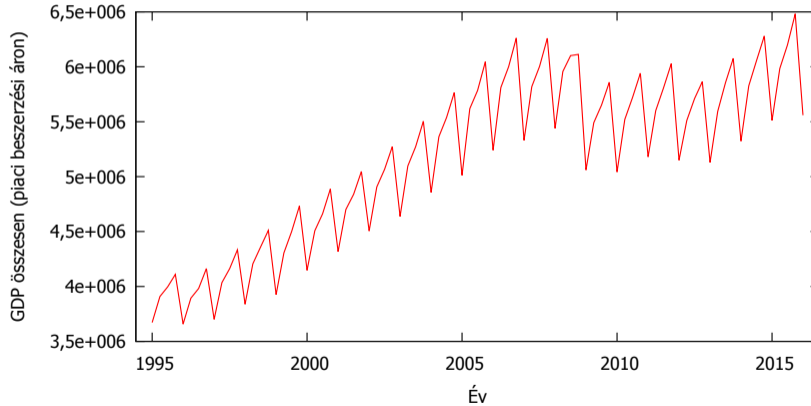
- Az egyetlen eltérés a keresztmetszethez képest: *sorrendjük* van (hatalmas jelentősége lesz majd)

Példa: magyar GDP (hosszú éves)

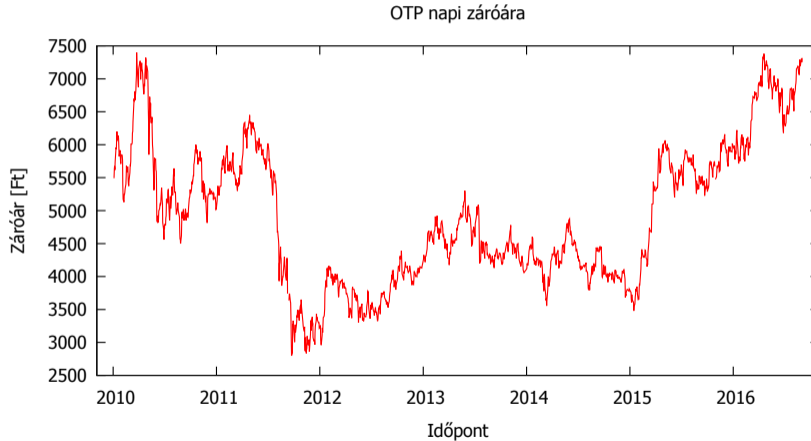


Példa: magyar GDP (negyedéves)

A bruttó hazai termék (GDP) termelése 2005. évi átlagáron, Magyarország



Példa: OTP napi záróár



Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Idősor sokaságban és mintában II.

- Sokasági definíció: valószínűségi változók indexelt halmaza (ahol az indexet „idő”-nek hívjuk):

$$\{Y_t, t \in N\}$$

- Az idősor egy időpontban tehát egy valószínűségi változó
- Itt az N tehát egy *rendezett* halmaz
- Valszámos szó: **sztochasztikus folyamat**
- Közgázban jellemzően N diszkrét, sőt véges: $N = \{1, 2, \dots, T\}$
- A minta tehát ennek egy realizációja (természetesen), itt a neve: **trajektória**

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája I.

- Mi a különbség 1406 lakás ára és az OTP 1406 napi záróárfolyama között?
 - Mi van emögött?
 - A függetlenség feltevés (tarthatósága)!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája I.

- Mi a különbség 1406 lakás ára és az OTP 1406 napi záróárfolyama között?
- Mi van emögött?
- A függetlenség feltevése (tarthatósága)!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája I.

- Mi a különbség 1406 lakás ára és az OTP 1406 napi záróárfolyama között?
- Mi van emögött?
- A függetlenség feltevés (tarthatósága)!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája II.

- Elég, ha ismerjük az egyes időpontok eloszlásait? (F_{Y_1} , F_{Y_2} stb.)
- Ami teljes mértékben leírja az idősort: az összes időpont együttes eloszlása:

$$F_{Y_1, Y_2, \dots, Y_T}$$

- (Igazából keresztmetszetenél is ez volt, csak a függetlenségi feltevés miatt esett szét egyváltozósokra)

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája II.

- Elég, ha ismerjük az *egyes időpontok* eloszlásait? (F_{Y_1} , F_{Y_2} stb.)
- Ami teljes mértékben leírja az idősort: az *összes időpont együttes* eloszlása:

$$F_{Y_1, Y_2, \dots, Y_T}$$

- (Igazából keresztmetszetről is ez volt, csak a függetlenségi feltevés miatt esett szét egyváltozósokra)

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája II.

- Elég, ha ismerjük az egyes időpontok eloszlásait? (F_{Y_1} , F_{Y_2} stb.)
- Ami teljes mértékben leírja az idősort: az összes időpont együttes eloszlása:

$$F_{Y_1, Y_2, \dots, Y_T}$$

- (Igazából keresztmetszetenél is ez volt, csak a függetlenségi feltevés miatt esett szét egyváltozósokra)

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája III.

- Azaz: 1 dimenziós adatra vett 100 megfigyelés vs. 100 dimenziósra vett 1 megfigyelés!
- (Ezért nem segít az sem, ha hosszabbítjuk az idősorunkat!)
- Hogyan lehet egyáltalán így bármi becsülni...?
- 1 megfigyelésből? Az érdekes lesz... → további feltevésekre lesz majd szükség!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája III.

- Azaz: 1 dimenziós adatra vett 100 megfigyelés vs. 100 dimenziósra vett 1 megfigyelés!
- (Ezért nem segít az sem, ha hosszabbítjuk az idősorunkat!)
- Hogyan lehet egyáltalán így bármi becsülni...?
- 1 megfigyelésből? Az érdekes lesz... → további feltevésekre lesz majd szükség!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája III.

- Azaz: 1 dimenziós adatra vett 100 megfigyelés vs. 100 dimenziósra vett 1 megfigyelés!
- (Ezért nem segít az sem, ha hosszabbítjuk az idősorunkat!)
- Hogyan lehet egyáltalán így bármi becsülni...?
- 1 megfigyelésből? Az érdekes lesz... → további feltevésekre lesz majd szükség!

Egyetlen realizáció (reprodukálhatatlanság) problémája III.

- Azaz: 1 dimenziós adatra vett 100 megfigyelés vs. 100 dimenziósra vett 1 megfigyelés!
- (Ezért nem segít az sem, ha hosszabbítjuk az idősorunkat!)
- Hogyan lehet egyáltalán így bármi becsülni...?
- 1 megfigyelésből? Az érdekes lesz... → további feltevésekre lesz majd szükség!

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősorelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősorelemzési iskolák, a módszerek felosztása
- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége

- A legtöbb közgazdasági adat *igazából* idősorként érhető el!
- Számos feladatnál időbeli a fókusz, gondoljunk a – szó szoros értelmében vett – előrejelzési kérdésekre

Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége

- A legtöbb közgazdasági adat *igazából* idősorként érhető el!
- Számos feladatnál időbeli a fókusz, gondoljunk a – szó szoros értelmében vett – előrejelzési kérdésekre

Idősoarelemlzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Idősorelemzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Idősoarelemlzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Idősorelemzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Idősoarelemlzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Idősoarelemlzés a közgazdaságtanban

- Eleinte: egyszerű determinisztikus módszerek (pl. dekompozíciós modellek már a XIX. században)
- Később regresszió is, de még tekintet nélkül az idősoros jellegre
- Cochrane és Orcutt mutatott rá először 1949-ben, hogy ez nem jó ötlet
- Megindult a kutatás ennek figyelembevételére
- Box és Jenkins könyve 1970-ben fordulópont: sztochasztikus módszerek
- Korszerű eljárások és aktuális kérdések (nemstacionaritás, nemlinearitás, többváltozós módszerek, ARCH, ...)

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősorelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősorelemzési iskolák, a módszerek felosztása
- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Az idősorelemzési módszerek csoportosítása

- Időtartomány vs. frekvenciatartomány (csak az előbbivel fogunk most foglalkozni)
- Determinisztikus vs. sztochasztikus (definíciós kavargások, most: a véletlennek van-e *folyamatépítő* szerepe; ld. később részletesen)
- Egyváltozós vs. többváltozós (+panel)

Az idősorelemzési módszerek csoportosítása

- Időtartomány vs. frekvenciatartomány (csak az előbbivel fogunk most foglalkozni)
- Determinisztikus vs. sztochasztikus (definíciós kavargások, most: a véletlennek van-e *folyamatépítő* szerepe; ld. később részletesen)
- Egyváltozós vs. többváltozós (+panel)

Az idősorelemzési módszerek csoportosítása

- Időtartomány vs. frekvenciatartomány (csak az előbbivel fogunk most foglalkozni)
- Determinisztikus vs. sztochasztikus (definíciós kavargások, most: a véletlennek van-e *folyamatépítő* szerepe; ld. később részletesen)
- Egyváltozós vs. többváltozós (+panel)

Tartalom

- 1 Az idősor fogalma, jelentősége, idősorelemzés
 - Az idősor fogalma
 - Az idősorelemzés közgazdasági jelentősége, története
 - Idősorelemzési iskolák, a módszerek felosztása

- 2 Idősorok jellemzői a sokaságban

Várhatóérték- és szórásnégyzet-függvény

Emlékezzünk rá, hogy egy adott időpontban az idősor egyszerűen egy valószínűségi változó, így definiálható várható értéke, szórásnégyzete, két ilyennek a kovarianciája; ez alapján:

- Várhatóérték-függvény ($\mu : N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\mu_t := \mathbb{E}Y_t$$

- Szórásnégyzet-függvény ($\sigma^2 : N \rightarrow \mathbb{R}_+$):

$$\sigma_t^2 := \mathbb{D}^2 Y_t = \mathbb{E}(Y_t - \mathbb{E}Y_t)^2 = \mathbb{E}(Y_t - \mu_t)^2 = \mathbb{E}Y_t^2 - \mu_t^2$$

Várhatóérték- és szórásnégyzet-függvény

Emlékezzünk rá, hogy egy adott időpontban az idősor egyszerűen egy valószínűségi változó, így definiálható várható értéke, szórásnégyzete, két ilyennek a kovarianciája; ez alapján:

- Várhatóérték-függvény ($\mu : N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\mu_t := \mathbb{E}Y_t$$

- Szórásnégyzet-függvény ($\sigma^2 : N \rightarrow \mathbb{R}_+$):

$$\sigma_t^2 := \mathbb{D}^2 Y_t = \mathbb{E}(Y_t - \mathbb{E}Y_t)^2 = \mathbb{E}(Y_t - \mu_t)^2 = \mathbb{E}Y_t^2 - \mu_t^2$$

Autokovariancia- és autokorreláció-függvény

- Autokovariancia-függvény (ACVF, $\gamma : N \times N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\begin{aligned}\gamma_{t,s} &:= \text{cov}(Y_t, Y_s) = \mathbb{E}[(Y_t - \mathbb{E}Y_t)(Y_s - \mathbb{E}Y_s)] = \\ &\mathbb{E}[(Y_t - \mu_t)(Y_s - \mu_s)] = \mathbb{E}(Y_t Y_s) - \mu_t \mu_s\end{aligned}$$

- Nyilván $\gamma_{t,t} = \sigma_t^2$
- Autokorrelációs függvény (ACF, $\rho : N \times N \rightarrow [-1, 1]$):

$$\rho_{t,s} := \text{corr}(Y_t, Y_s) = \frac{\gamma_{t,s}}{\sigma_t \sigma_s}$$

Ne feledjük: mindezekben semmi sztochasztikus nincs, teljesen közönséges – determinisztikus – függvények!

Autokovariancia- és autokorreláció-függvény

- Autokovariancia-függvény (ACVF, $\gamma : N \times N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\begin{aligned}\gamma_{t,s} &:= \text{cov}(Y_t, Y_s) = \mathbb{E}[(Y_t - \mathbb{E}Y_t)(Y_s - \mathbb{E}Y_s)] = \\ &\mathbb{E}[(Y_t - \mu_t)(Y_s - \mu_s)] = \mathbb{E}(Y_t Y_s) - \mu_t \mu_s\end{aligned}$$

- Nyilván $\gamma_{t,t} = \sigma_t^2$

- Autokorrelációs függvény (ACF, $\rho : N \times N \rightarrow [-1, 1]$):

$$\rho_{t,s} := \text{corr}(Y_t, Y_s) = \frac{\gamma_{t,s}}{\sigma_t \sigma_s}$$

Ne feledjük: mindezekben semmi sztochasztikus nincs, teljesen közönséges – determinisztikus – függvények!

Autokovariancia- és autokorreláció-függvény

- Autokovariancia-függvény (ACVF, $\gamma : N \times N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\begin{aligned}\gamma_{t,s} &:= \text{cov}(Y_t, Y_s) = \mathbb{E}[(Y_t - \mathbb{E}Y_t)(Y_s - \mathbb{E}Y_s)] = \\ &\mathbb{E}[(Y_t - \mu_t)(Y_s - \mu_s)] = \mathbb{E}(Y_t Y_s) - \mu_t \mu_s\end{aligned}$$

- Nyilván $\gamma_{t,t} = \sigma_t^2$
- Autokorrelációs függvény (ACF, $\rho : N \times N \rightarrow [-1, 1]$):

$$\rho_{t,s} := \text{corr}(Y_t, Y_s) = \frac{\gamma_{t,s}}{\sigma_t \sigma_s}$$

Ne feledjük: mindezekben semmi sztochasztikus nincs, teljesen közönséges – determinisztikus – függvények!

Autokovariancia- és autokorreláció-függvény

- Autokovariancia-függvény (ACVF, $\gamma : N \times N \rightarrow \mathbb{R}$):

$$\begin{aligned}\gamma_{t,s} &:= \text{cov}(Y_t, Y_s) = \mathbb{E}[(Y_t - \mathbb{E}Y_t)(Y_s - \mathbb{E}Y_s)] = \\ &\mathbb{E}[(Y_t - \mu_t)(Y_s - \mu_s)] = \mathbb{E}(Y_t Y_s) - \mu_t \mu_s\end{aligned}$$

- Nyilván $\gamma_{t,t} = \sigma_t^2$
- Autokorrelációs függvény (ACF, $\rho : N \times N \rightarrow [-1, 1]$):

$$\rho_{t,s} := \text{corr}(Y_t, Y_s) = \frac{\gamma_{t,s}}{\sigma_t \sigma_s}$$

Ne feledjük: mindezekben semmi sztochasztikus nincs, teljesen közönséges – determinisztikus – függvények!

Parciális autokorrelációs függvény (PACF)

- Úgy viszonyul az ACF-hez mint a sima (keresztmetszeti) parciális korreláció a korrelációhoz: bizonyos változókon keresztül terjedő hatásokat szűrjük (lineárisan)
- De melyikeket?
- Ami közbeesik: t és s közti korreláció ($s > t$), szűrve a $t + 1, t + 2, \dots, s - 2, s - 1$ időpontokon keresztül terjedő hatásokat
- Kiszámítható az ACF-ek ismeretében egyszerű mátrixműveletekkel
- (Avagy: a korreláció kijön egy olyan regresszióból, aminek egyetlen magyarázó változója van, a parciális korrelációhoz pedig hozzá kell adni a közbenső időpontokat is)

Parciális autokorrelációs függvény (PACF)

- Úgy viszonyul az ACF-hez mint a sima (keresztmetszeti) parciális korreláció a korrelációhoz: bizonyos változókon keresztül terjedő hatásokat szűrjük (lineárisan)
- De melyikeket?
- Ami közbeesik: t és s közti korreláció ($s > t$), szűrve a $t + 1, t + 2, \dots, s - 2, s - 1$ időpontokon keresztül terjedő hatásokat
- Kiszámítható az ACF-ek ismeretében egyszerű mátrixműveletekkel
- (Avagy: a korreláció kijön egy olyan regresszióból, aminek egyetlen magyarázó változója van, a parciális korrelációhoz pedig hozzá kell adni a közbenső időpontokat is)

Parciális autokorrelációs függvény (PACF)

- Úgy viszonyul az ACF-hez mint a sima (keresztmetszeti) parciális korreláció a korrelációhoz: bizonyos változókon keresztül terjedő hatásokat szűrjük (lineárisan)
- De melyikeket?
- Ami közbeesik: t és s közti korreláció ($s > t$), szűrve a $t + 1, t + 2, \dots, s - 2, s - 1$ időpontokon keresztül terjedő hatásokat
- Kiszámítható az ACF-ek ismeretében egyszerű mátrixműveletekkel
- (Avagy: a korreláció kijön egy olyan regresszióból, aminek egyetlen magyarázó változója van, a parciális korrelációhoz pedig hozzá kell adni a közbenső időpontokat is)

Parciális autokorrelációs függvény (PACF)

- Úgy viszonyul az ACF-hez mint a sima (keresztmetszeti) parciális korreláció a korrelációhoz: bizonyos változókon keresztül terjedő hatásokat szűrjük (lineárisan)
- De melyikeket?
- Ami közbeesik: t és s közti korreláció ($s > t$), szűrve a $t + 1, t + 2, \dots, s - 2, s - 1$ időpontokon keresztül terjedő hatásokat
- Kiszámítható az ACF-ek ismeretében egyszerű mátrixműveletekkel
- (Avagy: a korreláció kijön egy olyan regresszióból, aminek egyetlen magyarázó változója van, a parciális korrelációhoz pedig hozzá kell adni a közbelső időpontokat is)

Parciális autokorrelációs függvény (PACF)

- Úgy viszonyul az ACF-hez mint a sima (keresztmetszeti) parciális korreláció a korrelációhoz: bizonyos változókon keresztül terjedő hatásokat szűrjük (lineárisan)
- De melyikeket?
- Ami közbeesik: t és s közti korreláció ($s > t$), szűrve a $t + 1, t + 2, \dots, s - 2, s - 1$ időpontokon keresztül terjedő hatásokat
- Kiszámítható az ACF-ek ismeretében egyszerű mátrixműveletekkel
- (Avagy: a korreláció kijön egy olyan regresszióból, aminek egyetlen magyarázó változója van, a parciális korrelációhoz pedig hozzá kell adni a közbenső időpontokat is)

Korrelogram

- Korrelogram: ACF és PACF együtt ábrázolva
- (Egyelőre úgy tűnik, hogy ez egy kétdimenziós függvény, ezt majd később árnyalni fogjuk – és ezért nem is ábrázoljuk most még ténylegesen)
- Jelentősége: ha ismerjük nevezetes folyamatok – elméleti – korrelogramját, akkor egy minta mögötti, azt adó folyamatra következtethetünk az alapján, hogy a minta – empirikus – korrelogramja hogyan néz ki
- (Sajnos a gyakorlatban sokszor csak hozzávetőleges lehet)

Korrelogram

- Korrelogram: ACF és PACF együtt ábrázolva
- (Egyelőre úgy tűnik, hogy ez egy kétdimenziós függvény, ezt majd később árnyalni fogjuk – és ezért nem is ábrázoljuk most még ténylegesen)
- Jelentősége: ha ismerjük nevezetes folyamatok – elméleti – korrelogramját, akkor egy minta mögötti, azt adó folyamatra következtethetünk az alapján, hogy a minta – empirikus – korrelogramja hogyan néz ki
- (Sajnos a gyakorlatban sokszor csak hozzávetőleges lehet)

Korrelogram

- Korrelogram: ACF és PACF együtt ábrázolva
- (Egyelőre úgy tűnik, hogy ez egy kétdimenziós függvény, ezt majd később árnyalni fogjuk – és ezért nem is ábrázoljuk most még ténylegesen)
- Jelentősége: ha ismerjük nevezetes folyamatok – elméleti – korrelogramját, akkor egy minta mögötti, azt adó folyamatra következtethetünk az alapján, hogy a minta – empirikus – korrelogramja hogyan néz ki
- (Sajnos a gyakorlatban sokszor csak hozzávetőleges lehet)

Korrelogram

- Korrelogram: ACF és PACF együtt ábrázolva
- (Egyelőre úgy tűnik, hogy ez egy kétdimenziós függvény, ezt majd később árnyalni fogjuk – és ezért nem is ábrázoljuk most még ténylegesen)
- Jelentősége: ha ismerjük nevezetes folyamatok – elméleti – korrelogramját, akkor egy minta mögötti, azt adó folyamatra következtethetünk az alapján, hogy a minta – empirikus – korrelogramja hogyan néz ki
- (Sajnos a gyakorlatban sokszor csak hozzávetőleges lehet)