

Временные ряды 2

...

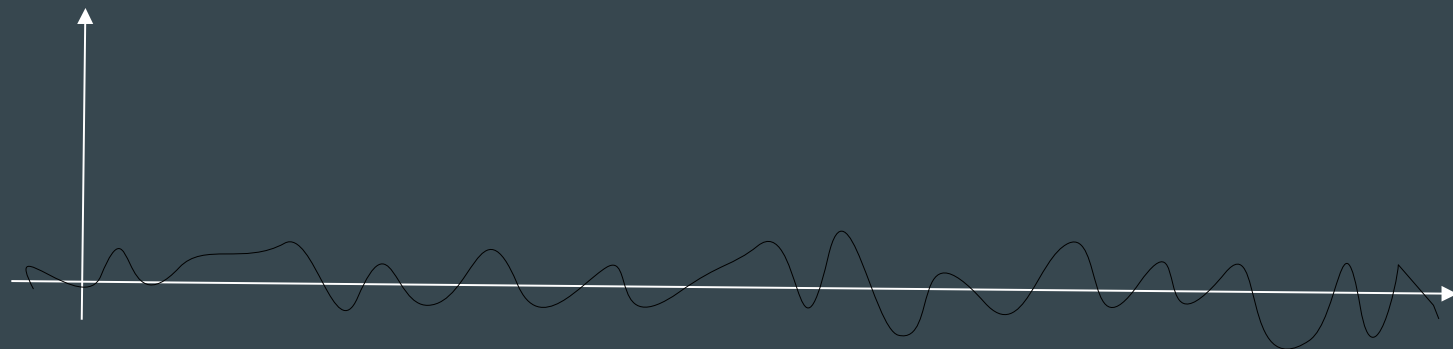
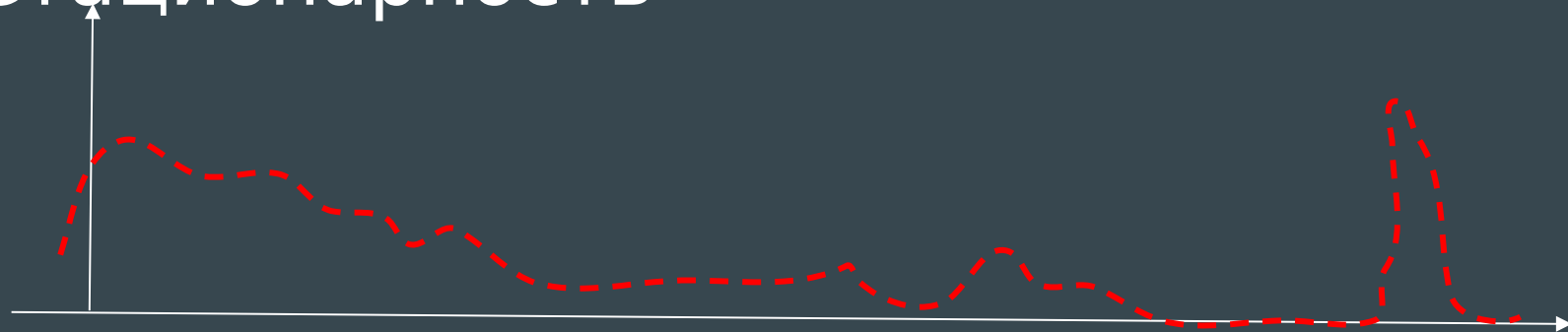
Построение признаков

2019

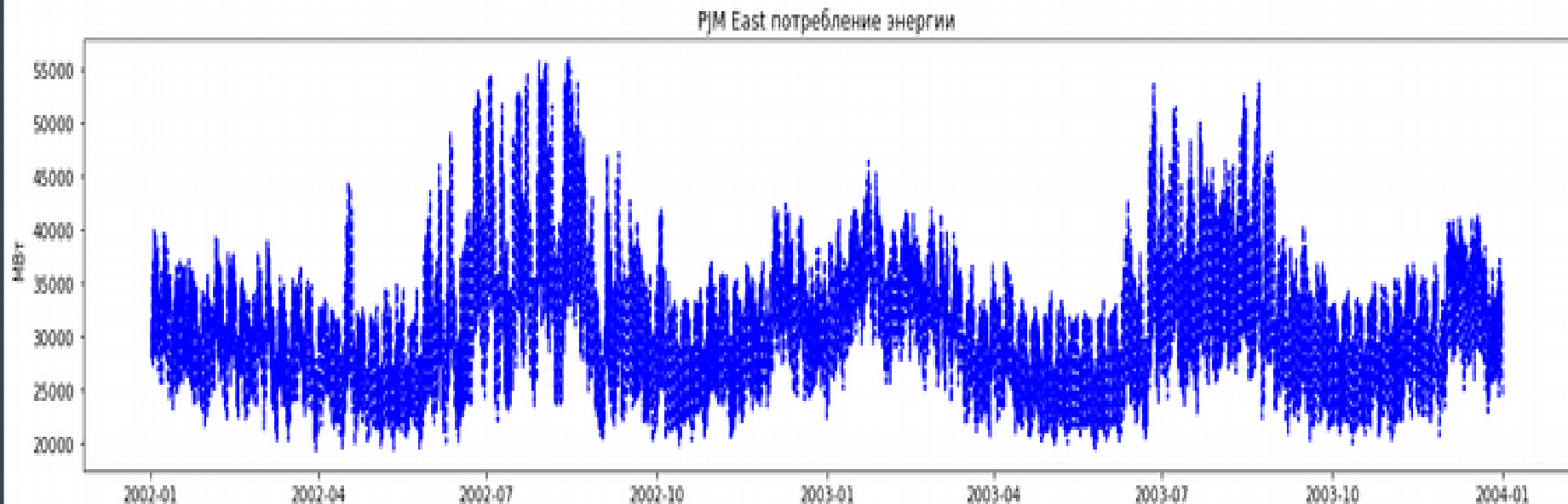
План

1. ДЗ1
2. Теоретическая часть
 - а. Понятие стационарного ряда
 - б. Тренд , цикл , Сезон
 - с. Интегральный ряд
 - д. Модели временного ряда
 - е. Сглаживание
 - ф. тест ADF
3. Практическая часть - построение признаков от значений ряда
 - а. как запустить анализ стационарности
 - б. как запустить сглаживание
 - с. как собрать модель
 - д. ДЗ 2

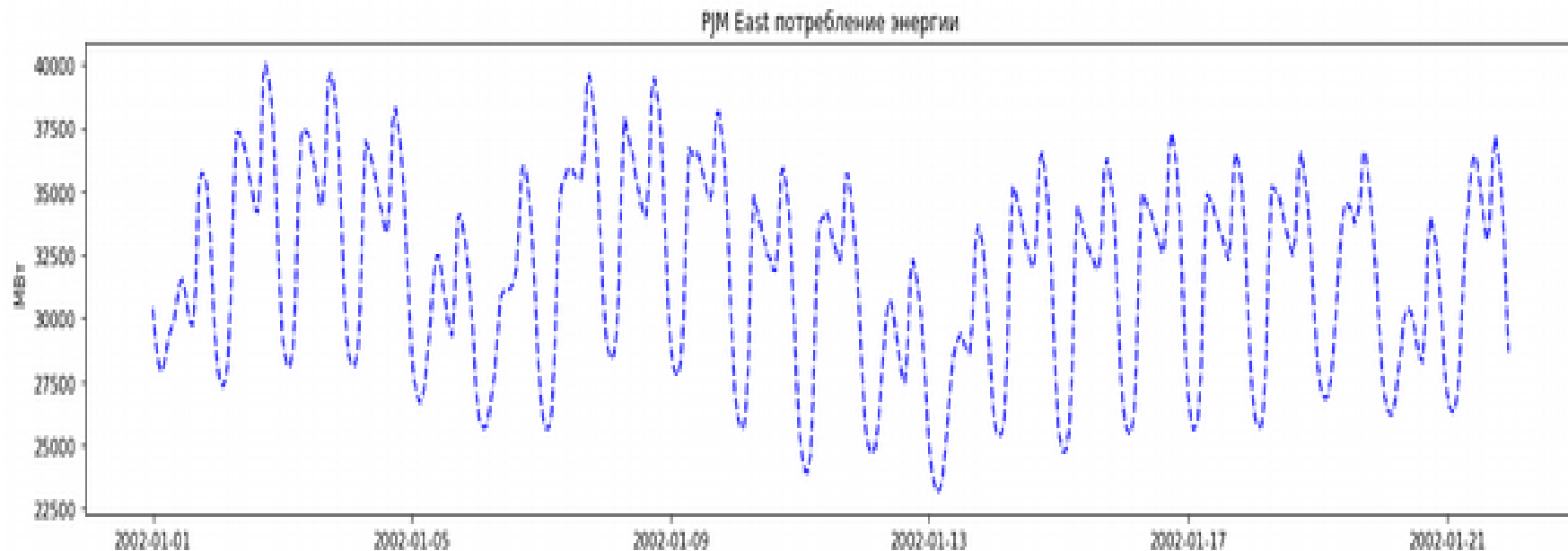
Стационарность



Потребление энергии



Потребление энергии



Стационарность

Важно:

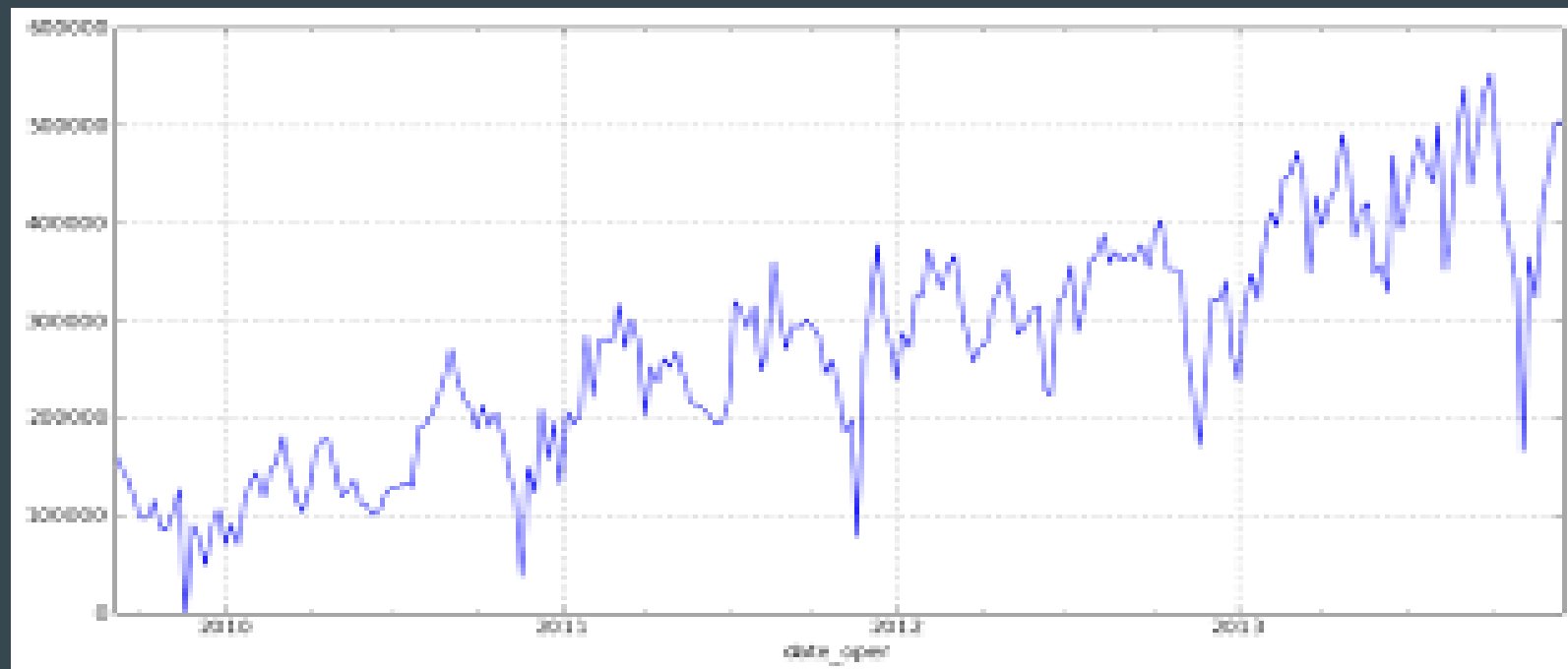
- Интервал анализа

Стационарность

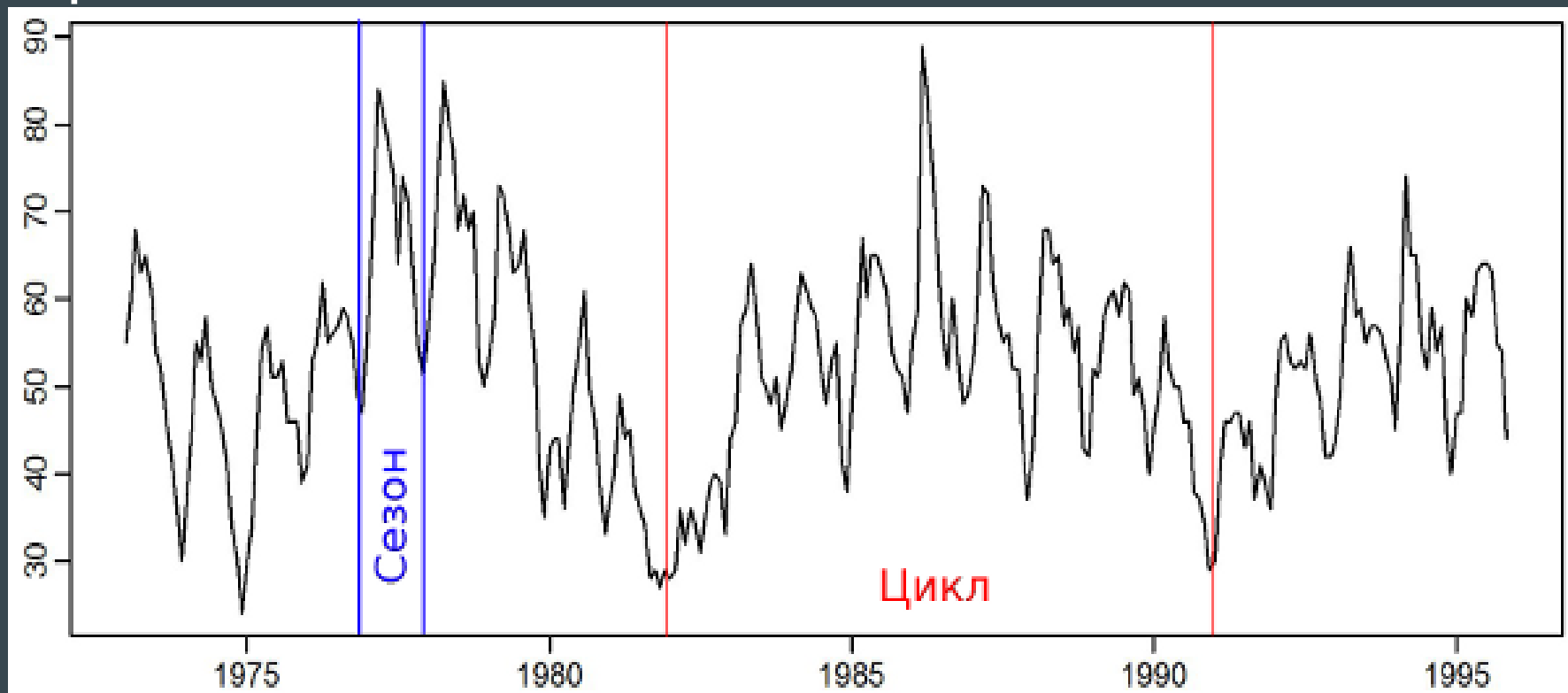
Постоянство :

- Мат.ожидания
- Дисперсии
- автоковариация стационарного ряда с лагом L
- коэффициент автокорреляция стационарного ряда с лагом L

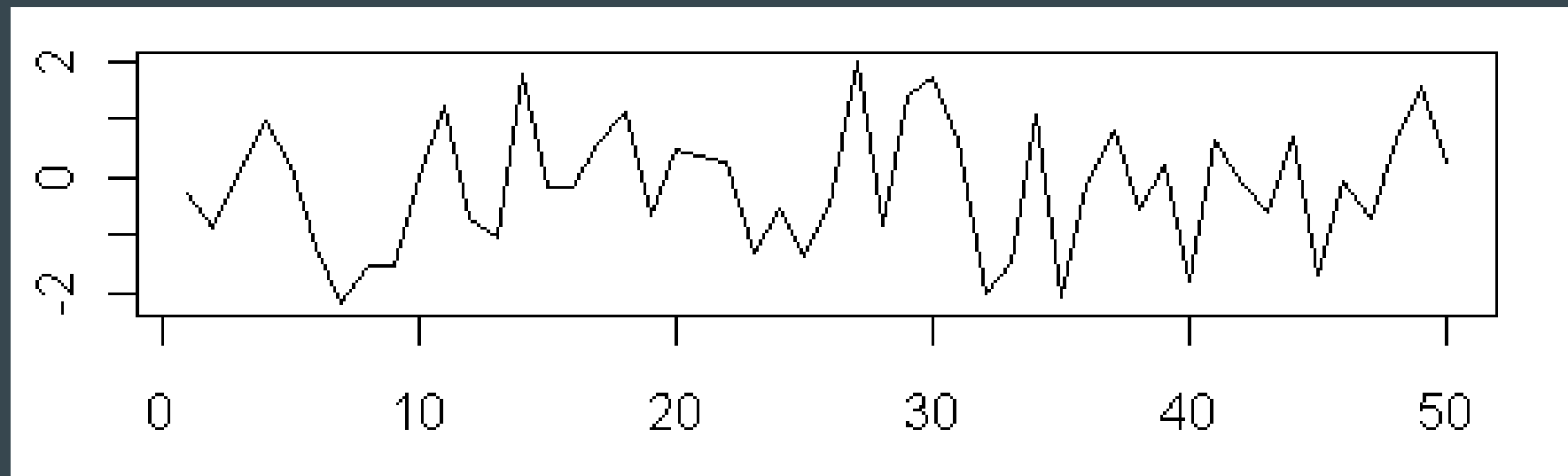
Тренд



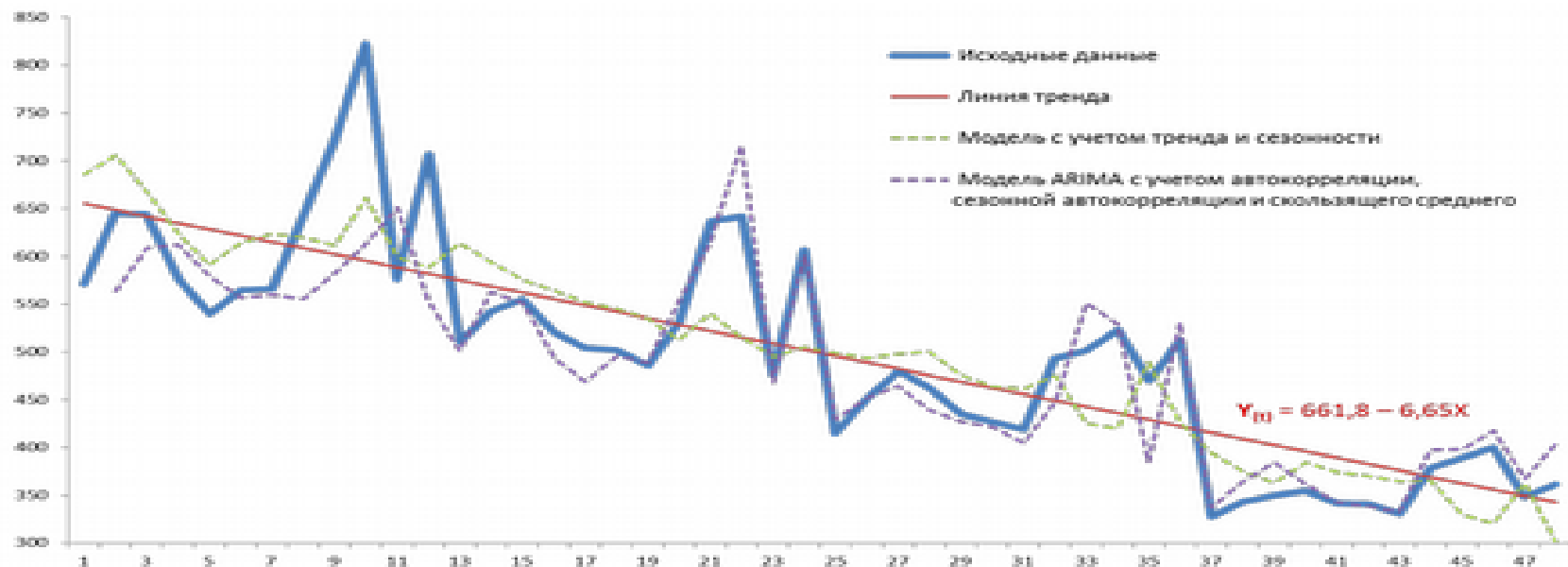
Цикл



шум



ВСЕ ВМЕСТЕ



Модель ряда

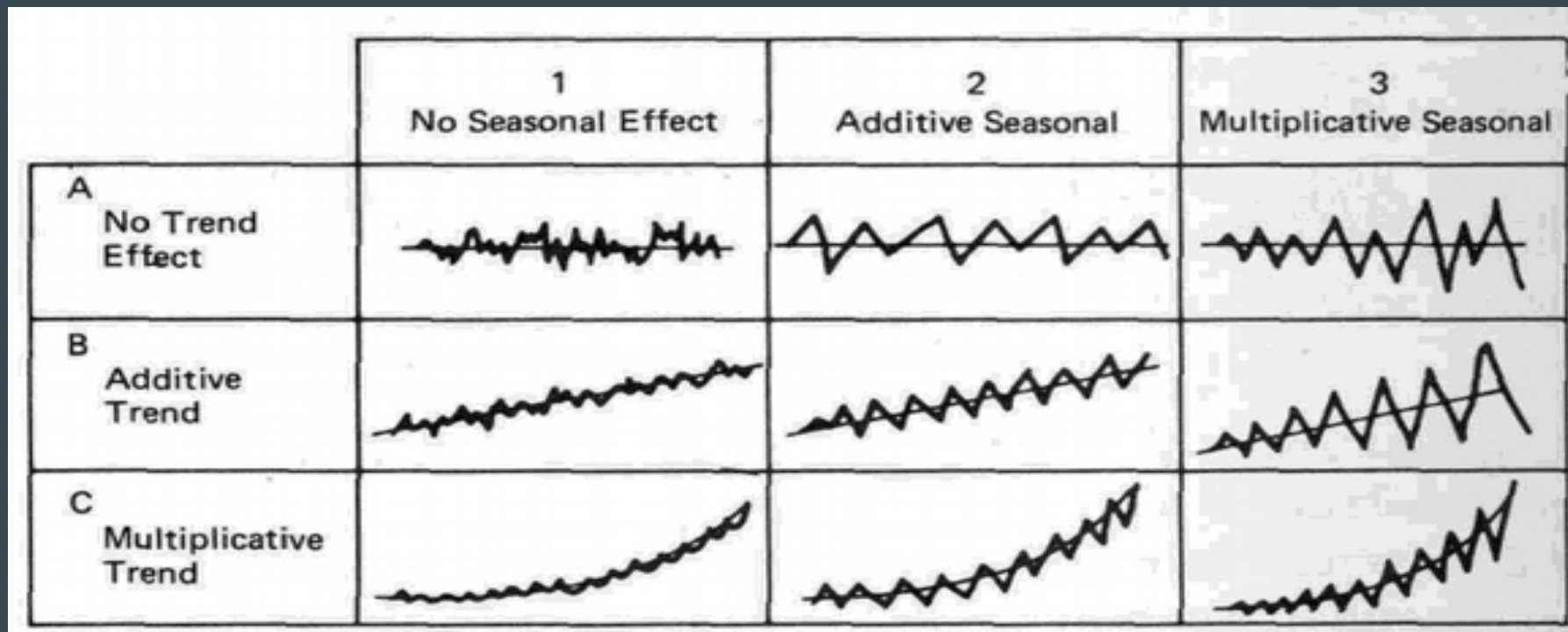
- аддитивная :

$$y(t) = X_{\text{trend}}(t) + X_{\text{cycle}}(t) + e(t)$$

- мультипликативная :

$$y(t) = X_{\text{trend}}(t) X_{\text{cycle}}(t) e(t)$$

Виды рядов



Сглаживание

Скользящие средние

$$x_NEW(i) = (x(i-n) + x(n-i+1) + \dots + x(i)) * 1/(n + 1).$$

n - порядок

Сглаживание

Экспоненциальное

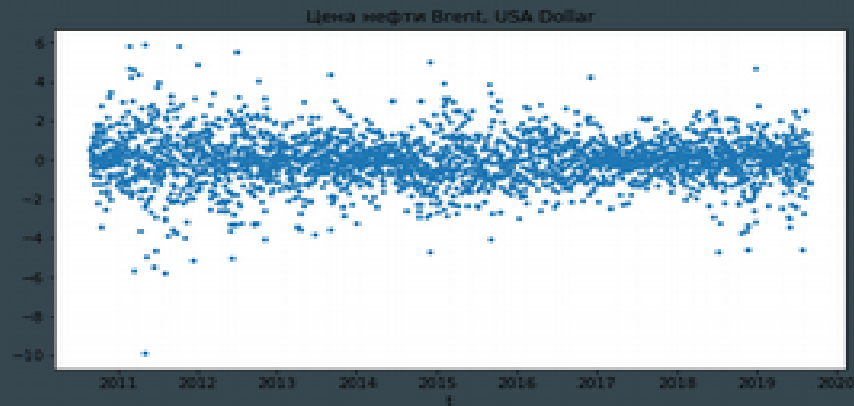
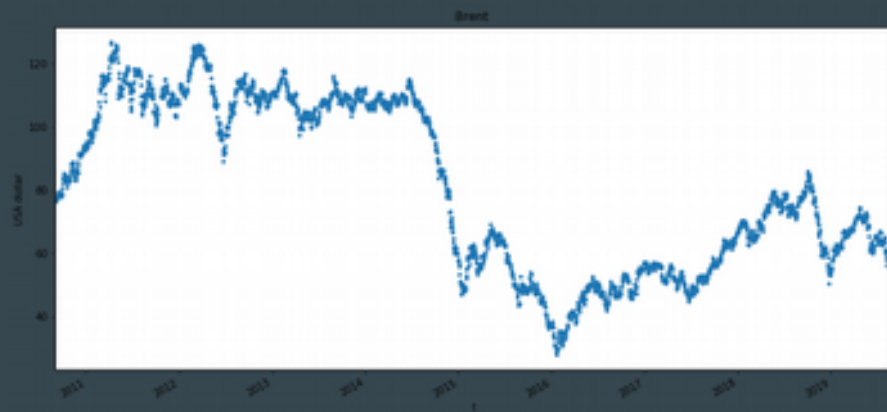
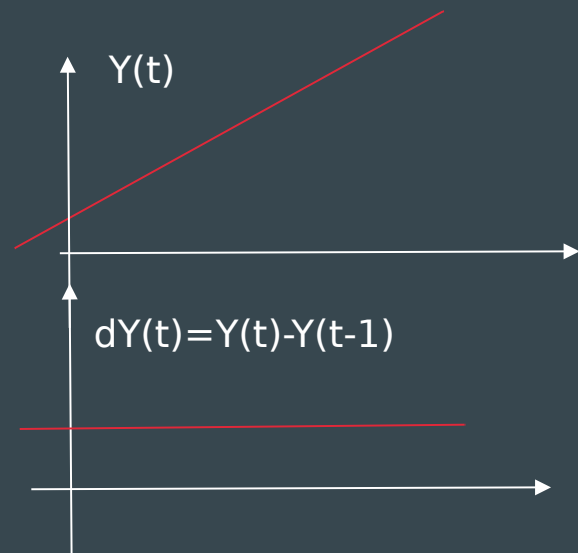
$$x_NEW(i) = (x(i)*a + (1-a)*(x(n-i+1)* a + (1-a)*(...+ (1-a)*(x(i-n))))$$

$$x_NEW(i) = (x_NEW(i-1)*(1-a) + a*x(i))$$

a - порядок

Первые разности

$$dY(t) = Y(t) - Y(t-1)$$



Тест Дики-Фуллера

авторегрессия $Y(t) = b * Y(t-1) + e_t$

авторегрессия для 1-х разностей $dY(t) = b * Y(t-1) + e_t$

d - оператор разности $dY(t) = Y(t) - Y(t-1)$

$Y(t) = a_1 Y(t-1) + a_2 Y(t-2) + e_t$

$dY(t) = Y(t) - Y(t-1)$

$dY(t) = (a_1 + a_2 - 1) Y(t-1) - a_2 dY(t-1) + e_t$

проверяем $a_1 + a_2 - 1 = 0$

Тест Дики-Фуллера

основная гипотеза $H_0: b=1$

авторегрессия $Y(t) = b * Y(t-1) + \epsilon_t$

на следующем этапе: $H_0: p=0$

авторегрессия для разностей $dY(t) = p * Y(t-1) + \epsilon_t$, $p=b-1$

d - оператор разности $dY(t) = Y(t)-Y(t-1)$

$Y(t) = a_1 Y(t-1) + a_2 Y(t-2) + \epsilon_t$

$dY(t) = (a_1 + a_2 - 1) Y(t-1) - a_2 dY(t-1) + \epsilon_t$

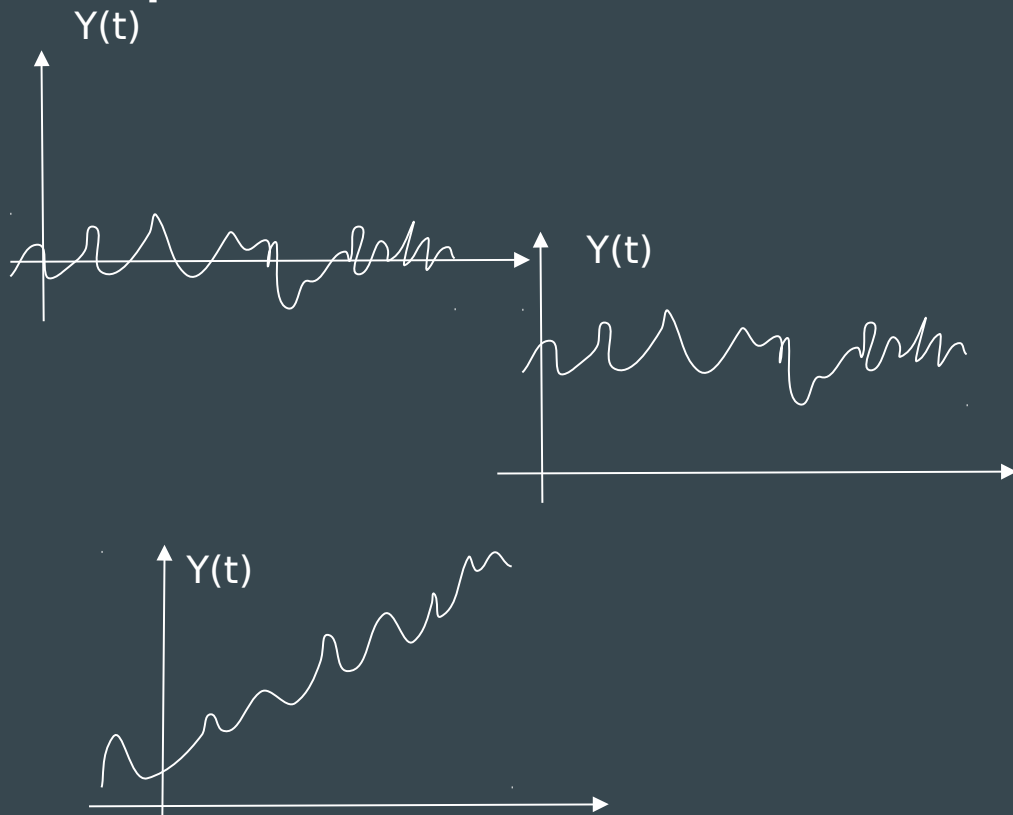
проверяем $a_1 + a_2 - 1 = 0$

Тест Дики-Фуллера

$$dY(t) = pY(t-1) + et$$

$$dY(t) = a + pY(t-1) + et$$

$$dY(t) = a + c t + pY(t-1) + et;$$



Тест Дики-Фуллера

Односторонний

Порядок тестирования:

- ➔ вторые разности ряда :

- ➔ если гипотеза отвергается, то идем дальше

- ➔ не более чем 2 раза интегрируемый,

- ➔ первые разности ряда :

- ➔ если гипотеза отвергается, то идем дальше

- ➔ не более чем 1 раз интегрируемый,

- ➔ исходный ряд :

- ➔ если гипотеза отвергается, то стационарный