

Časové řady – dekompozice, analýza trendu a sezónnosti

Supplementum ke cvičení 4ST210 Statistika pro finance

Lubomír Štěpánek^{1, 2}



¹Oddělení biomedicínské statistiky
Ústav biofyziky a informatiky
1. lékařská fakulta
Univerzita Karlova, Praha



²Katedra biomedicínské informatiky
Fakulta biomedicínského inženýrství
České vysoké učení technické v Praze

(2020) Lubomír Štěpánek, CC BY-NC-ND 3.0 (CZ)



Dílo lze dále svobodně šířit, ovšem s uvedením původního autora a s uvedením původní licence. Dílo není možné šířit komerčně ani s ním jakkoliv jinak nakládat pro účely komerčního zisku. Dílo nesmí být jakkoliv upravováno. Autor neručí za správnost informací uvedených kdekoli v předložené práci, přesto vynaložil nezanedbatelné úsilí, aby byla uvedená fakta správná a aktuální, a práci sepsal podle svého nejlepšího vědomí a svých „nejlepších“ znalostí problematiky.

Obsah

- 1 Opakování
- 2 Složky časové řady, dekompozice
- 3 Trendová složka časové řady
- 4 Sezónní složka časové řady
- 5 Literatura

Příklad

- V příloženém souboru _12_cviceni_.xlsx jsou v záložce pocty_pracovniku hodnoty počty pracovníků daného podniku vždy k prvnímu dni každého měsíce v rámci roku. Spočítejme
 - (i) difference prvního řádu,
 - (ii) meziměsíční tempa růstu,
 - (iii) průměrné teplo růstu
 - (iv) a chronologický průměr počtu pracovníků¹.

¹ Jako váhy sčítanců v průměru použijme vždy délky měsíců ve dnech.

Časová řada

- časová řada je posloupnost hodnot uspořádaných v čase od minulosti do současnosti
 - obvykle (ne však vždy) se předpokládá konstantní časový krok mezi každými dvěma sousedními hodnotami časové řady

Dělení časových řad

- dle délky časového kroku mezi sousedními hodnotami řady
 - **krátkodobé řady** – je-li časový krok kratší než jeden rok²
 - např. čtvrtletní, měsíční, týdenní, denní, minutová časová řada, atd.
 - **dlouhodobé řady** – je-li časový krok alespoň jeden rok
- dle vztahu hodnoty k časovému kroku
 - **okamžikové řady** – hodnota v každém časovém okamžiku představuje nepředpočítanou velikost dané veličiny
 - např. cena akcií na burze, počet obyvatel na Zemi, směnný kurz €–U.S.\$ na FOREXu, atd.
 - nemá smysl nad hodnotami takové řady provádět součty
 - **intervalové řady** – hodnota v každém časovém okamžiku představuje předpočítanou velikost dané veličiny ve smyslu úhrnu (součtu) či průměru
 - např. HDP dle čtvrtletí, úmrtnost na karcinom plic ročně za posledních deset let, počet prodaných automobilů měsíčně v daném regionu atd.

²jde o historické dělení, v současnosti v podstatě překonané kvůli *high-frequency* časovým řadám např. u algoritmického obchodování s peněžními deriváty, kde je časový krok řádově v nanosekundách

Složky časové řady

- časovou řadu $\{y\}_{t=1}^n = \{y_1, y_2, y_3, \dots, y_n\}$ lze dekomponovat na několik složek
 - (i) trend T_t , tedy setrvalou tendenci vývoje
 - (ii) sezónnost S_t , tedy pravidelně se opakující odchylku s periodou kratší než jeden rok
 - (iii) cyklus C_t , tedy pravidelně se opakující odchylku s periodou alespoň jednoho roku
 - (iv) náhodnou složku ε_t , kterou nelze vysvětlit jinak
- dekompozice může být aditivní

$$y_t = T_t + S_t + C_t + \varepsilon_t$$

- nebo multiplikativní

$$y_t = T_t \cdot S_t \cdot C_t \cdot \varepsilon_t$$

Parametrické modelování trendu T_t časové řady

- trend modelujeme jako parametrickou křivku, tedy např. přímku, parabolu, exponenciálu apod.
- parametry zvolené parametrické křivky je třeba odhadnout tak, aby křivka „dobře“ odpovídala³ hodnotám časové řady
 - odhad parametrů křivky může být založen na minimalizaci součtu čtverců odchylek mezi skutečnými hodnotami časové řady a vždy příslušnými hodnotami časové řady vypočtenými na základě křivky trendu

³v určitém slova smyslu

Volba parametrické křivky trendu T_t časové řady

- založena na věcné znalosti dané problematiky
- může odrážet charakteru rozložení hodnot časové řady v bodovém diagramu $[t, y_t]_{t=i}^n$
- jsou-li difference prvního řádu konstantní a difference druhého řádu nulové, volíme *přímku*
- jsou-li difference druhého řádu konstantní a difference třetího řádu nulové, volíme *parabolu*
- jsou-li mezihodnotová tempa růstu konstantní, volíme *exponenciálu*

Příklad

- V příloženém souboru _12_cviceni_.xlsx jsou v záložce kolorektalni_karcinom je incidence nových případů kolorektálního karcinomu v Praze pro roky 1998 až 2005. Proložme časovou řadu přímkovým trendem. Nyní zanedbáváme jakoukoliv možnost přítomnosti sezónní složky.

Příklad

- V příloženém souboru `_12_cviceni_.xlsx` jsou v záložce `obrat_startupu` jsou roční úhrny obratu jistého startupu v milionech korun. Proložme časovou řadu exponenciálním trendem. Nyní zanedbáváme jakoukoliv možnost přítomnosti sezónní složky.

Neparametrické modelování trendu T_t časové řady

- též zvané *vyhlazování*
- existují různé sofistikované metody (exponenciální vyhlazování i jiné)
- běžně se ale používá pouze *klouzavý průměr*
- trend tedy nemodelujeme jako parametrickou křivku pomocí regrese, ale pouze počítáme průměrnou hodnotu vždy pomocí několika sousedních hodnot časové řady
- prostý klouzavý průměr pro vyhlazení sezónnosti liché délky

$$\bar{y}_t = \frac{y_{t-p} + y_{t-p+1} + \cdots + y_t + \cdots + y_{t+p-1} + y_{t+p}}{m}$$

kde $m = 2p + 1$ je okénko klouzavého průměru

- centrováný klouzavý průměr pro vyhlazení sezónnosti sudé délky

$$\bar{y}_t = \frac{y_{t-p} + 2y_{t-p+1} + \cdots + 2y_t + \cdots + 2y_{t+p-1} + y_{t+p}}{2m}$$

kde $m = 2p$ je okénko klouzavého průměru

Příklad

- V příloženém souboru `_12_cviceni_.xlsx` jsou v záložce `HDP_1994_az_2000` je čtvrtletní časová řada HDP České republiky v období od 1. čtvrtletí 1994 do 4. čtvrtletí 2000. Vyrovnáme tuto časovou řadu klouzavými průměry délky 5.

Sezónní složka S_t časové řady

- sezónnost je pravidelně se opakující odchylka s periodou kratší než jeden rok
- modeluje se různě, včetně regresního přístupu
- uvažujeme-li u časové řady $\{y\}_{t=1}^n = \{y_1, y_2, y_3, \dots, y_n\}$ aditivní dekompozici a přítomnost trendu T_t a sezónnosti S_t , můžeme psát

$$y_t = T_t + S_t + C_t + \varepsilon_t$$

kde ε_t je náhodná složka

- po přepisu do podoby regresní křivky dostáváme pro sezónnost délky k časových kroků

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 t + \gamma_1 D_1 + \gamma_2 D_2 + \dots + \gamma_{k-1} D_{k-1} + \varepsilon_t$$

kde t je (lineární) trend a γ_j a D_j je lineární koeficient a dummy proměnná j -tého časového kroku sezónnosti, kde $j \in \{1, 2, \dots, k-1\}$; hodnota sezónnosti k -ho časového kroku je $\beta_0 + \beta_1 t$

Sezónní složka S_t časové řady pro čtvrtletí ($k = 4$)

- uvažujeme-li sezónnost pro čtvrtletí, pak $k = 4$
- regresní křivka má pro sezónnost délky $k = 4$ časových kroků tvar

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 t + \gamma_1 D_1 + \gamma_2 D_2 + \gamma_3 D_3 + \varepsilon_t$$

kde t je (lineární) trend a γ_j a D_j je lineární koeficient a dummy proměnná j -tého čtvrtletí, kde $j \in \{1, 2, 3\}$; hodnota sezónnosti 4-ho čtvrtletí je $\beta_0 + \beta_1 t$

Korekce sezónní složky S_t časové řady pro čtvrtletí ($k = 4$)

- odhadneme-li regresní křivku pro čtvrtletí následovně

$$y_t = \beta_0 + \beta_1 t + \gamma_1 D_1 + \gamma_2 D_2 + \gamma_3 D_3 + \varepsilon_t$$

pak je nutné provést přepočítání pomocí $\hat{s} = \frac{\hat{\gamma}_1^* + \hat{\gamma}_2^* + \hat{\gamma}_3^* + 0}{4}$, abychom získali skutečné hodnoty odhadů pro jednotlivá čtvrtletí S_{j+4i} , kde $i \in \mathbb{N}$

$$S_{1+4i} = \hat{\gamma}_1^* - \hat{s}$$

$$S_{2+4i} = \hat{\gamma}_2^* - \hat{s}$$

$$S_{3+4i} = \hat{\gamma}_3^* - \hat{s}$$

$$S_{4+4i} = -\hat{s}$$

- trendová složka má tvar $\hat{T}_t = (\hat{\beta}_0^* + \hat{s}) + \hat{\beta}_1^* t$ a sezónní složka má tvar $\hat{S}_t = \widehat{S_{1+4i}} Q_1 + \widehat{S_{2+4i}} Q_2 + \widehat{S_{3+4i}} Q_3 + \widehat{S_{4+4i}} Q_4$, kde Q_1, \dots, Q_4 identifikují čtvrtletí

Příklad

- V příloženém souboru `_12_cviceni_.xlsx` jsou v záložce `HDP_sezonnost` je čtvrtletní časová řada HDP České republiky v období od 1. čtvrtletí 2002 do 4. čtvrtletí 2006. Modelujme trendovou a sezónní složku pomocí regresního přístupu a odhadněme vývoj této časové řady na rok 2007.

Literatura



Hindls, Richard, Stanislava Hronová, Jan Seger a Jakub Fischer. *Statistika pro ekonomy*. Praha: Professional Publishing, 2007. ISBN: 978-80-86946-43-6.



Marek, Luboš. *Statistika v příkladech*. Praha: Professional Publishing, 2015. ISBN: 978-80-7431-153-6.

Děkuji za pozornost!

lubomir.stepanek@vse.cz

lubomir.stepanek@lf1.cuni.cz

lubomir.stepanek@fbmi.cvut.cz

https://github.com/LStepanek/4ST210_Statistika_pro_finance