

## 1. Вспомогательные определения

В данном разделе введем некоторые обозначения, которые будем использовать в дальнейшем.

**Определение 1.1.** Случайный процесс  $\{Y_t : t \in \mathbb{Z}\}$  называют стационарным (в широком смысле), если

1.  $EY_t \equiv \text{const}$  (среднее постоянно по времени);
2.  $\text{cov}(Y_t, Y_{t+h}) = \gamma(h)$  (ковариация зависит только от лага  $h$ ).

**Замечание 1.1.** Поскольку  $\gamma(0) = \text{cov}(Y_t, Y_t) = DY_t$ , то дисперсия также не меняется со временем.

**Замечание 1.2.** Далее под стационарностью будет подразумеваться именно стационарность в широком смысле.

**Определение 1.2.** Случайный процесс  $\{\varepsilon_t\}$  называют белым шумом  $\text{WN}(0, \sigma^2)$ , если он стационарный,  $E\varepsilon_t = 0$ ,  $\gamma(h) = 0 \ \forall h \neq 0$  и  $D\varepsilon_t = \sigma^2$ .

**Определение 1.3.** Моделью  $\text{ARMA}(p, q)$ , где  $p, q \in \mathbb{N} \cup \{0\}$  называют случайный процесс  $\{X_t\}$ , удовлетворяющий соотношению

$$X_t = \varepsilon_t + \sum_{i=1}^p \phi_i X_{t-i} + \sum_{i=1}^q \theta_i \varepsilon_{t-i},$$

где  $\{\varepsilon_t\} \sim \text{WN}(0, \sigma^2)$ .

**Определение 1.4.** Спектральной плотностью стационарного процесса называется такая функция  $f(\omega)$ , что

$$\gamma(h) = 2 \int_0^{1/2} e^{2\pi h \omega i} f(\omega) d\omega.$$

**Определение 1.5.** Пусть  $\{Y_t\}$  — стационарный процесс. Функцию

$$I(\omega) = \frac{1}{n} \left| \sum_{j=1}^n Y_j e^{-2\pi \omega j i} \right|^2$$

называют периодограммой выборки размера  $n$  процесса  $\{Y_t\}$ .

## 2. Процессы с длинной памятью

**Определение 2.1.** Говорят, что стационарный процесс  $\{Y_t\}$  обладает длинной памятью, если

$$\sum_{h=0}^H |\gamma(h)| \rightarrow \infty,$$

при  $H \rightarrow \infty$ . Иначе говорят, что  $\{Y_t\}$  обладает короткой памятью:

$$\sum_{h=0}^{\infty} |\gamma(h)| < \infty.$$

Существуют и альтернативные определения процессов с длинной памятью, которые можно найти в [1, Section 3.1]. Там же показано, что они согласованы с определением 2.1.

**Пример 2.1.** Процессом с короткой памятью является, например, стационарная модель  $\text{ARMA}(p, q)$ , поскольку  $|\gamma(h)| \leq CR^h$ , где  $C > 0$  и  $0 < R < 1$  [2].

Введем понятие дробного интегрирования  $(1 - L)^d$ , где  $L$  — оператор сдвига. Например, для  $d = 1$  имеем  $(1 - L)Y_t = Y_t - Y_{t-1}$ , для  $d = 2$  —  $(1 - L)^2 Y_t = Y_t - 2Y_{t-1} + Y_{t-2}$ , и так далее. Обобщим этот оператор для нецелых  $d$  с помощью разложения в ряд Тейлора функции  $(1 - x)^d$  в нуле:

$$\begin{aligned} (1 - x)^d &= 1 - dx - \frac{d(1-d)}{2}x^2 - \frac{d(1-d)(2-d)}{3!}x^3 - \dots \\ &= \sum_{j=0}^{\infty} \pi_j(d)x^j = \sum_{j=0}^{\infty} \binom{d}{j} (-1)^j x^j, \end{aligned}$$

где  $\binom{d}{j}$  — обобщенный биномиальный коэффициент. Коэффициенты  $\pi_j(d)$  удовлетворяют соотношению

$$\pi_j(d) = (-1)^j \binom{d}{j} = \frac{j-1-d}{j} \pi_{j-1}(d) = \frac{\Gamma(j-d)}{\Gamma(j+1)\Gamma(-d)}, \quad (1)$$

где  $\Gamma(x)$  — гамма функция. Заметим, что второе равенство в формуле (1) верно для любых  $d$ , третье же верно только для  $d \notin \mathbb{N} \cup \{0\}$ , поскольку гамма функция не определена для неположительных целых чисел.

**Определение 2.2.** Пусть процесс  $\{Y_t\}$  определен соотношением

$$Y_t = (1 - L)^{-d} X_t = \sum_{k=0}^{\infty} \pi_k(-d) X_{t-k}, \quad d < 1/2,$$

где  $\pi_k(-d)$  из формулы (1),  $\{X_t\}$  — стационарная и обратимая модель  $\text{ARMA}(p, d)$ . Процесс  $\{Y_t\}$  называют дробно интегрированной моделью  $\text{ARMA}$  или  $\text{ARFIMA}(p, d, q)$ .

**Замечание 2.1.** При  $p = q = 0$  процесс  $\{X_t\}$  из определения 2.2 является белым шумом. В таком случае процесс  $\{Y_t\}$  называют дробно интегрированным шумом или  $\text{FIN}(d)$ .

**Предложение 2.1.**  $\text{ARFIMA}(p, d, q)$  является стационарным процессом с нулевым средним при  $d < 1/2$ . Его спектральная плотность определяется выражением

$$\begin{aligned} f(\omega) &= \sigma^2 4^{-d} \sin^{-2d}(\pi\omega) \frac{|\theta(e^{-2\pi\omega i})|^2}{|\phi(e^{-2\pi\omega i})|^2}, \quad \omega > 0 \\ &\sim \sigma^2 \omega^{-2d} \frac{|\theta(1)|^2}{|\phi(1)|^2}, \quad \omega \rightarrow 0, \end{aligned} \quad (2)$$

*Доказательство.* См. [3, Proposition 6.1]. □

**Замечание 2.2.** Из формулы (2) видно, что спектральная плотность дробно интегрированного процесса монотонно убывает (возрастает) тогда и только тогда, когда монотонно убывает (возрастает) спектральная плотность процесса  $\{X_t\}$ .

**Следствие 2.1.** В условиях предложения 2.1 при  $0 < d < 1/2$

$$\gamma(h) \sim C_{\gamma,d} h^{2d-1}, \quad h \rightarrow \infty,$$

где

$$C_{\gamma,d} = \sigma^2 \frac{|\theta(1)|^2}{|\phi(1)|^2} \frac{\Gamma(1-2d)}{\Gamma(d)\Gamma(1-d)}.$$

*Доказательство.* См. [3, Corollary 6.1]. □

**Замечание 2.3.** Из следствия 2.1 сразу следует, что  $\text{ARFIMA}(p, d, q)$  с  $d \in (0, 1/2)$  обладает длинной памятью.

## 2.1. Возникновение процессов с длинной памятью

Нас интересуют процессы с монотонной спектральной плотностью, поскольку они довольно распространены в реальном мире. Такими процессами являются процессы со степенной спектральной плотностью  $f(\omega) \sim \omega^{-\alpha}$ , имеющие большое применение в различных областях, например, в физике, биологии, астрофизике, геофизике и экономике.

Процессы с длинной памятью, являющиеся частным случаем процессов со степенной спектральной плотностью, довольно распространены. Например, в работе [4] обнаружена длинная память в таких среднегодовых гидрологических временных рядах, как количество осадков, температура и данных о речном стоке. В работе [5] на наличие

длинной памяти исследовалась скорость ветра в Ирландии, в работе [6] исследовался эффект длинной памяти у сейсмических данных. Помимо геофизики, длинная память встречается также в финансах [7, 8].

### 3. Оценка параметров

Пусть  $Y_t = (1 - L)^{-d} X_t$ ,  $d < 1/2$ . Будем считать, что  $\{X_t\}$  представляет собой модель ARMA( $p, q$ ) с нормально распределенным белым шумом  $\{\varepsilon_t\}$ . Тогда его спектральная плотность  $f_X(\omega) = f_X(\omega; \boldsymbol{\psi}, \sigma)$ , где

$$\boldsymbol{\psi} = (\phi_1, \dots, \phi_p, \theta_1, \dots, \theta_q)^T.$$

Поставим задачу оценить параметры  $\boldsymbol{\varphi}^T = (d, \boldsymbol{\psi}^T)$  и  $\sigma^2$ .

#### 3.1. Maximum likelihood estimation (MLE)

Поскольку  $\{\varepsilon_t\}$  — гауссовский белый шум, вектор

$$\mathbf{Y} = (Y_1, \dots, Y_n)^T \sim \mathcal{N}_n(\mathbf{0}, \boldsymbol{\Sigma}_n),$$

где  $\boldsymbol{\Sigma}_n = (\gamma(|i - j|))_{i,j=1}^n$  — ковариационная матрица  $\mathbf{Y}$ . Совместная плотность распределения  $\mathbf{Y}$  равна

$$(2\pi)^{-n/2} |\boldsymbol{\Sigma}_n|^{-1/2} \exp \left\{ -\frac{1}{2} \mathbf{Y}^T \boldsymbol{\Sigma}_n^{-1} \mathbf{Y} \right\}.$$

Рассмотрим логарифм функции правдоподобия. Отбрасывая аддитивные константы, получаем

$$\ell(\boldsymbol{\varphi}, \sigma^2) = -\frac{1}{2} \ln |\boldsymbol{\Sigma}_n| - \frac{1}{2} \mathbf{Y}^T \boldsymbol{\Sigma}_n^{-1} \mathbf{Y}.$$

Положим  $\boldsymbol{\Gamma}_n = \boldsymbol{\Sigma}_n / \sigma^2$  и, максимизируя  $\ell$  по  $\sigma^2$ , получаем

$$\ell_c(\boldsymbol{\varphi}) = -\frac{n}{2} \ln (S(\boldsymbol{\varphi})/n) - \frac{1}{2} \ln g_n(\boldsymbol{\varphi}),$$

где  $S(\boldsymbol{\varphi}) = \mathbf{Y}^T \boldsymbol{\Gamma}_n \mathbf{Y}$ ,  $g_n(\boldsymbol{\varphi}) = |\boldsymbol{\Gamma}_n|$ . Тогда  $\hat{\boldsymbol{\varphi}}_{\text{ML}} = \underset{\boldsymbol{\varphi}}{\operatorname{argmax}} \ell_c(\boldsymbol{\varphi})$  и  $\hat{\sigma}_{\text{ML}}^2 = S(\hat{\boldsymbol{\varphi}}_{\text{ML}})$ .

**Замечание 3.1.** В случае ненулевого матожидания  $\mathbb{E}Y_t = \mu$ , для получения оценок максимального правдоподобия нужно вместо  $\mathbf{Y}$  рассматривать  $\mathbf{Z} = \mathbf{Y} - \mu$ .

### 3.2. Whittle estimation

Метод максимального правдоподобия применим, когда известно матожидание  $\mu$ . Можно вместо истинного среднего использовать его оценку  $\bar{\mathbf{Y}}$ , однако, помимо этого, существует проблема вычислительной сложности метода при больших  $n$ .

Обе эти проблемы можно решить, используя оценку Уиттла (Whittle): вместо логарифма функции правдоподобия рассматривается ее оценка (с точностью до константы) [9]. Пусть  $f(\omega, \boldsymbol{\varphi}, \sigma^2)$  — спектральная плотность  $\{Y_t\}$ ,  $I(\omega)$  — периодограмма  $\mathbf{Y}$ , тогда

$$\ell_W(\boldsymbol{\varphi}, \sigma^2) = -\frac{1}{m} \sum_{j=1}^m \left( \ln f(\omega_j; \boldsymbol{\varphi}, \sigma^2) + \frac{I(\omega_j)}{f(\omega_j; \boldsymbol{\varphi}, \sigma^2)} \right),$$

где  $m = \lfloor (n-1)/2 \rfloor$ ,  $\omega_j = j/n$ ,  $j = 1, 2, \dots, m$ . Заметим, что  $f(\omega; \boldsymbol{\varphi}, \sigma^2) = \sigma^2 g(\omega; \boldsymbol{\varphi})$ . Тогда, максимизируя  $\ell_W$  по  $\sigma^2$ , получаем

$$\hat{\boldsymbol{\varphi}}_W = \operatorname{argmax}_{\boldsymbol{\varphi}} Q(\boldsymbol{\varphi}), \quad \hat{\sigma}_W^2 = \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m \frac{I(\omega_j)}{g(\omega_j; \hat{\boldsymbol{\varphi}}_W)},$$

где

$$Q(\boldsymbol{\varphi}) = -\ln \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m \frac{I(\omega_j)}{g(\omega_j; \boldsymbol{\varphi})} - \frac{1}{m} \sum_{j=1}^m \ln g(\omega_j; \boldsymbol{\varphi}).$$

## Список литературы

1. Palma Wilfredo. Long-Memory Time Series: Theory and Methods. — Wiley, 2006.
2. Time Series Analysis: Forecasting and Control / Box G., Jenkins G., Reinsel G., and Ljung G. — Fifth ed. — 2016.
3. Hassler Uwe. Time Series Analysis with Long Memory in View. — Wiley, 2018.
4. Hipel Keith W., McLeod Ian. Time series modelling of water resources and environmental systems. — Elsevier, 1994.
5. Haslett John, Raftery Adrian E. Space-Time Modelling with Long-Memory Dependence: Assessing Ireland's Wind Power Resource // Journal of the Royal Statistical Society. Series C (Applied Statistics). — 1989. — Vol. 38, no. 1. — P. 1–50.
6. Long memory effects and forecasting of earthquake and volcano seismic data / Mari-ani Maria C., Bhuiyan Md Al Masum, Tweneboah Osei K. and Gonzalez-Huizar Hector // Physica A: Statistical Mechanics and its Applications. — 2020. — Vol. 559. — P. 125049.
7. Barkoulas J., Labys W. C., Onochie J. I. Fractional dynamics in international commodity prices // Journal of Futures Markets. — 1997. — Vol. 17. — P. 161–189.
8. Guglielmo Maria Caporale Luis Gil-Alana, Plastun Alex. Long memory and data frequency in financial markets // Journal of Statistical Computation and Simulation. — 2019. — Vol. 89, no. 10. — P. 1763–1779.
9. Whittle P. The Analysis of Multiple Stationary Time Series // Journal of the Royal Statistical Society. Series B (Methodological). — 1953. — P. 125–139.