

6: Spuriøs regression og kointegration

Tidsrækkeanalyse

Kasper Rosenkrands

Spuriøs regression

En spuriøs sammenhæng ses mellem to variable som er korrelerede men ikke kan bruges til at forklare korrelationen.

Et eksempel på en spuriøs sammenhæng er samvariationen mellem antal isvafler der sælges og antal drukneulykker. Sammenhængen er spuriøs da vi ikke kan konkludere at man drukner af at spise en isvaffel, der er nok nærmere en underliggende variabel som påvirker begge disse variable (årstiden for eksempel).

I tidsrækkeanalyse kaldes det for **spuriøs regression** når man kigger på sammenhænge mellem uafhængige ikke-stationære tidsrækker.