

# **ARIMA и сезонная ARIMA**

**Буковка І**

# Буковка I: план

- Стационарность  $ARMA$ .

# Буковка I: план

- Стационарность  $ARMA$ .
- Определение  $ARIMA$ .

# Буковка I: план

- Стационарность  $ARMA$ .
- Определение  $ARIMA$ .
- Нужно ли переходить к разностям?

# ARMA процесс

## Определение

$ARMA(p, q)$  процессом с несократимым уравнением

$$y_t = c + \beta_1 y_{t-1} + \dots + \beta_p y_{t-p} + u_t + \alpha_1 u_{t-1} + \dots + \alpha_q u_{t-q},$$

где  $(u_t)$  — белый шум,  $\beta_p \neq 0$  и  $\alpha_q \neq 0$ , называется решение этого уравнения вида  $MA(\infty)$  относительно  $(u_t)$ .

# ARMA процесс

## Определение

$ARMA(p, q)$  процессом с несократимым уравнением

$$y_t = c + \beta_1 y_{t-1} + \dots + \beta_p y_{t-p} + u_t + \alpha_1 u_{t-1} + \dots + \alpha_q u_{t-q},$$

где  $(u_t)$  — белый шум,  $\beta_p \neq 0$  и  $\alpha_q \neq 0$ , называется решение этого уравнения вида  $MA(\infty)$  относительно  $(u_t)$ .

## Определение с лагами

$ARMA(p, q)$  процессом с уравнением

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t,$$

где  $(u_t)$  — белый шум,  $P(L)$  степени  $p$  и  $Q(L)$  степени  $q$  несократимы,  $P(0) = Q(0) = 1$ , называется решение этого уравнения вида  $MA(\infty)$  относительно  $(u_t)$ .

# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен по определению:



# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен по определению:  
 $\mathbb{E}(y_t) = \mu_y, \text{Var}(y_t) = \gamma_0, \text{Cov}(y_t, y_{t-k}) = \gamma_k.$

# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен по определению:  
 $\mathbb{E}(y_t) = \mu_y, \text{Var}(y_t) = \gamma_0, \text{Cov}(y_t, y_{t-k}) = \gamma_k.$
- В канонической записи  $ARMA(p, q)$  процесса  
 $P(L)y_t = c + Q(L)u_t$  у полинома  $P(L)$  все корни  $|\ell| > 1.$

# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен по определению:  
 $\mathbb{E}(y_t) = \mu_y, \text{Var}(y_t) = \gamma_0, \text{Cov}(y_t, y_{t-k}) = \gamma_k.$
- В канонической записи  $ARMA(p, q)$  процесса  
 $P(L)y_t = c + Q(L)u_t$  у полинома  $P(L)$  все корни  $|\ell| > 1$ .  
Возможны неканонические варианты.

# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен **по определению**:  
 $\mathbb{E}(y_t) = \mu_y, \text{Var}(y_t) = \gamma_0, \text{Cov}(y_t, y_{t-k}) = \gamma_k$ .
- В **канонической записи**  $ARMA(p, q)$  процесса  
 $P(L)y_t = c + Q(L)u_t$  у полинома  $P(L)$  все корни  $|\ell| > 1$ .  
Возможны неканонические варианты.
- При оценке  $ARMA(p, q)$  процесса методом  
максимального правдоподобия эти ограничения  
наложены **а-приори**.

# Нюансы

- Процесс  $y_t \sim ARMA(p, q)$  стационарен **по определению**:  
 $\mathbb{E}(y_t) = \mu_y, \text{Var}(y_t) = \gamma_0, \text{Cov}(y_t, y_{t-k}) = \gamma_k$ .
- В **канонической записи**  $ARMA(p, q)$  процесса  
 $P(L)y_t = c + Q(L)u_t$  у полинома  $P(L)$  все корни  $|\ell| > 1$ .  
Возможны неканонические варианты.
- При оценке  $ARMA(p, q)$  процесса методом  
максимального правдоподобия эти ограничения  
наложены **а-приори**.  
Есть упрощённые варианты правдоподобия.

# Что делать с нестационарными процессами?

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 1, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  нестационарен, но  $\Delta y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

# Что делать с нестационарными процессами?

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 1, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  нестационарен, но  $\Delta y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 2, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  и  $(\Delta y_t)$  нестационарны, но  $\Delta^2 y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

# Что делать с нестационарными процессами?

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 1, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  нестационарен, но  $\Delta y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 2, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  и  $(\Delta y_t)$  нестационарны, но  $\Delta^2 y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

$$\Delta y_t = y_t - y_{t-1} \text{ и } \Delta^2 y_t = \Delta y_t - \Delta y_{t-1}$$



# Что делать с нестационарными процессами?

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 1, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  нестационарен, но  $\Delta y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

## Определение

Случайный процесс  $(y_t)$  называется  $ARIMA(p, 2, q)$  процессом относительно белого шума  $(u_t)$ , если  $(y_t)$  и  $(\Delta y_t)$  нестационарны, но  $\Delta^2 y_t$  — стационарный  $ARMA(p, q)$  процесс относительно белого шума  $(u_t)$ .

$$\Delta y_t = y_t - y_{t-1} \text{ и } \Delta^2 y_t = \Delta y_t - \Delta y_{t-1}$$

ARIMA — AutoRegressive Integrated Moving Average

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на график!

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на график!

График стационарного процесса колеблется в полосе постоянной ширины вокруг своего ожидания.

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

$\ln L(y_1, \dots, y_n \mid \theta)$  и  $\ln L(y_2, \dots, y_n \mid \theta, y_1)$  и  $\ln L(y_3, \dots, y_n \mid \theta, y_1, y_2)$  несравнимы!



# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

$\ln L(y_1, \dots, y_n \mid \theta)$  и  $\ln L(y_2, \dots, y_n \mid \theta, y_1)$  и  $\ln L(y_3, \dots, y_n \mid \theta, y_1, y_2)$  несравнимы!

- Есть **тесты на единичный корень!**

# Как выбрать?

$ARIMA(p, 0, q)$  или  $ARIMA(p, 1, q)$  или  $ARIMA(p, 2, q)$

- Посмотреть на **график!**

График стационарного процесса колеблется в **полосе постоянной ширины** вокруг своего ожидания.

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

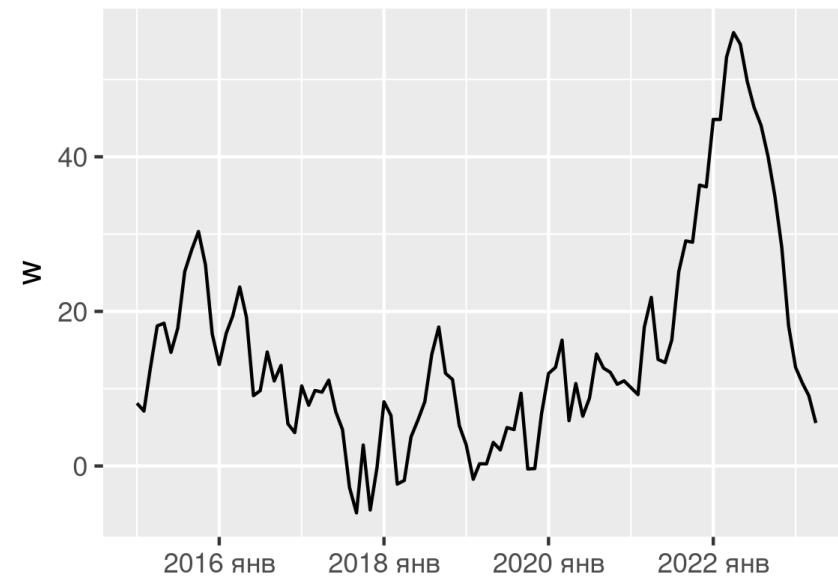
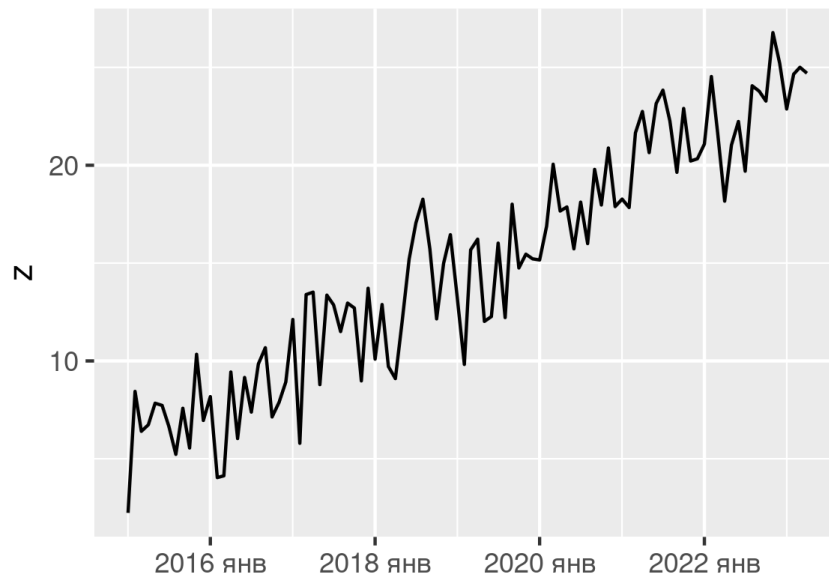
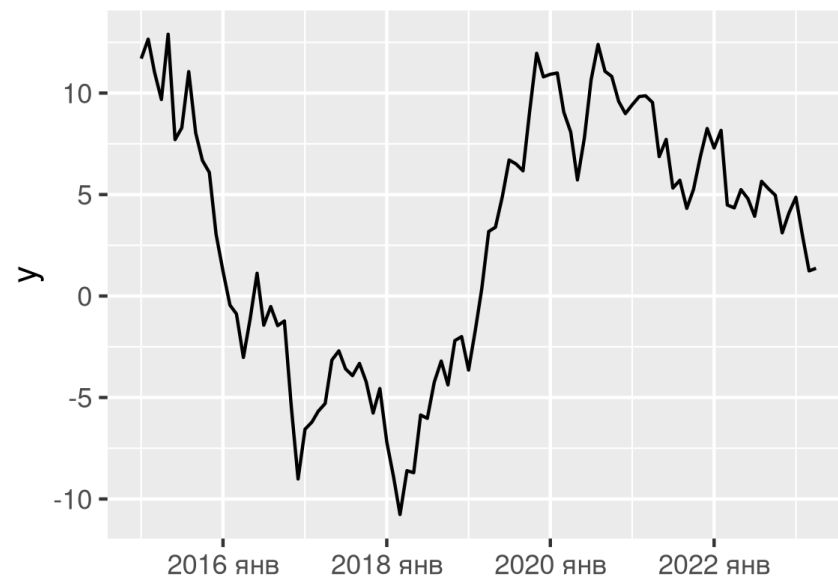
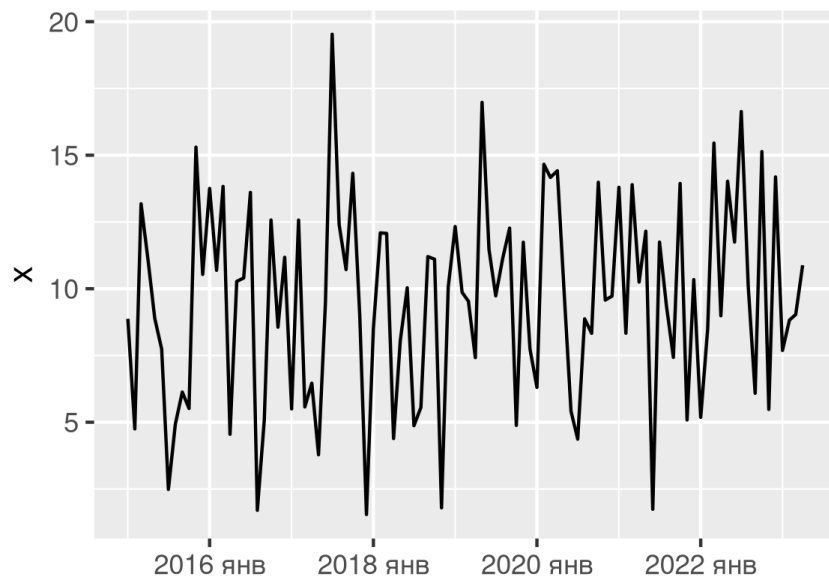
- **Применять  $AIC$  нельзя!**

$\ln L(y_1, \dots, y_n \mid \theta)$  и  $\ln L(y_2, \dots, y_n \mid \theta, y_1)$  и  $\ln L(y_3, \dots, y_n \mid \theta, y_1, y_2)$  несравнимы!

- Есть **тесты на единичный корень!**

ADF, KPSS, PP, ...

# Выбираем «на глазок»



# Буковка I: итоги

- $ARMA$  подходит только для стационарных рядов.

# Буковка I: итоги

- *ARMA* подходит только для **стационарных** рядов.
- Иногда стационарен  $\Delta y_t$  или  $\Delta^2 y_t$ .

# Буковка I: итоги

- $ARMA$  подходит только для **стационарных** рядов.
- Иногда стационарен  $\Delta y_t$  или  $\Delta^2 y_t$ .
- Выбираем между  $ARMA$  и  $ARIMA$ .

**ADF тест**

# ADF тест: план

- Предположения теста.



# ADF тест: план

- Предположения теста.
- Алгоритм теста.

# ADF тест: план

- Предположения теста.
- Алгоритм теста.
- Три вариации теста.

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать  $ARMA$  модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать  $ARMA$  модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?
- Как включать константу в модель?

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать *ARMA* модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?
- Как включать константу в модель?

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать  $ARMA$  модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?
- Как включать константу в модель?

Название «тест на единичные корни»:

# Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать *ARMA* модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?
- Как включать константу в модель?

Название «тест на единичные корни»:

$$\Delta = 1 - L = P(L)$$

Уравнение  $1 - \ell = 0$  имеет корень  $\ell = 1$ .



# ADF тест

## **Расшифровка**

Augmented Dickey Fuller test

Расширенный тест Дики-Фуллера

# ADF тест

## Расшифровка

Augmented Dickey Fuller test

Расширенный тест Дики-Фуллера

Три вариации теста: без константы, с константой, с трендом.

# ADF с константой

$$\Delta y_t = c + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

# ADF с константой

$$\Delta y_t = c + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$$\Delta y_t = m + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + mt + \sum_{i=1}^t x_i;$$

# ADF с константой

$$\Delta y_t = c + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$$\Delta y_t = m + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

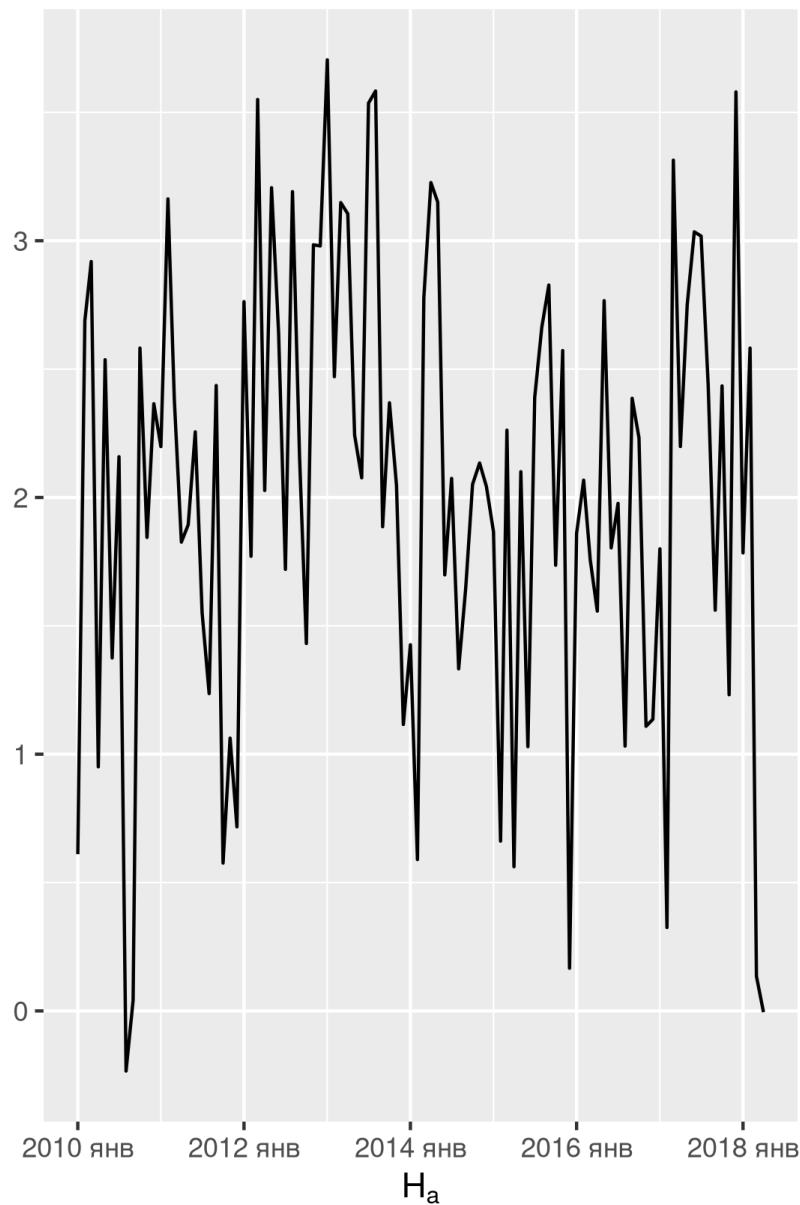
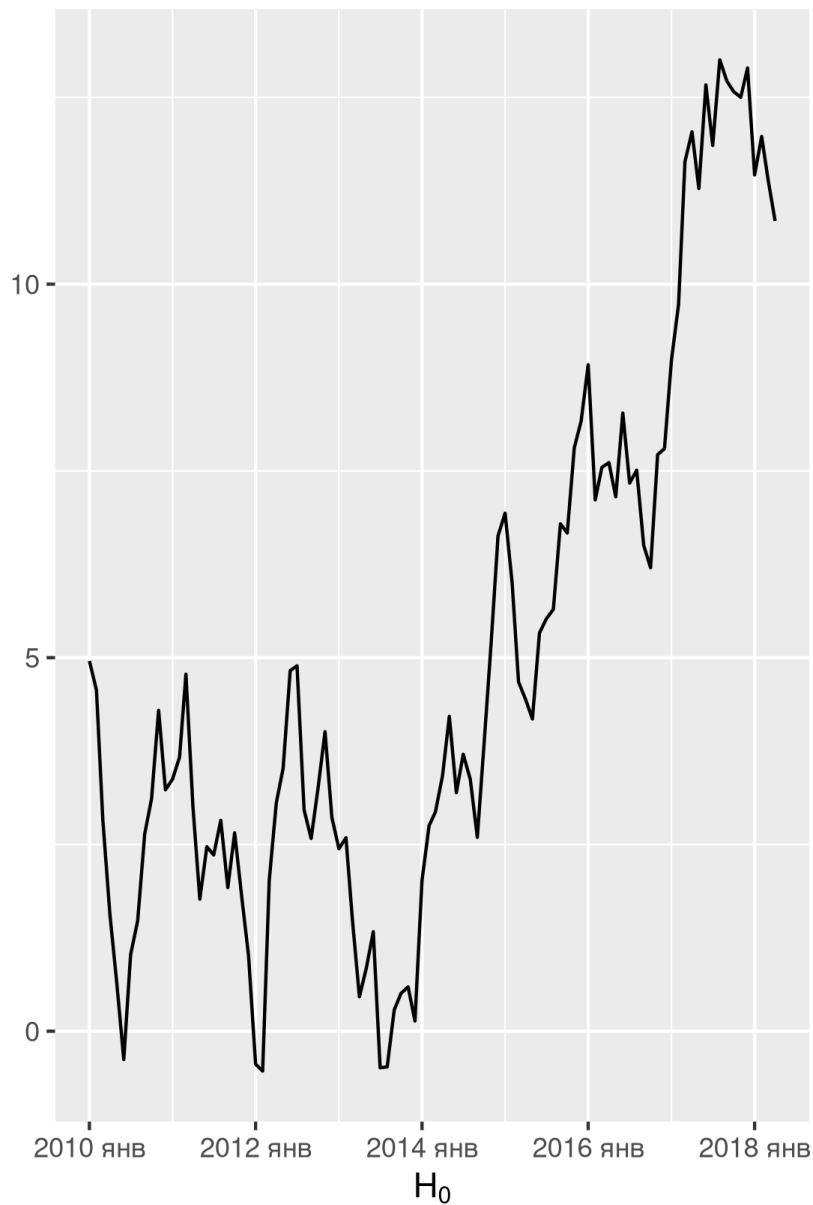
$$y_t = y_0 + mt + \sum_{i=1}^t x_i;$$

$$H_a: \beta < 0;$$

$(y_t)$  — стационарный  $AR(p + 1)$  процесс;

# ADF с константой: $H_0$ и $H_a$

ADF с константой



# ADF с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию**

$$\widehat{\Delta y_t} = \hat{c} + \hat{\beta} y_{t-1} + \hat{d}_1 \Delta y_{t-1} + \dots + \hat{d}_p \Delta y_{t-p}.$$

# ADF с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию**

$$\widehat{\Delta y_t} = \hat{c} + \hat{\beta} y_{t-1} + \hat{d}_1 \Delta y_{t-1} + \dots + \hat{d}_p \Delta y_{t-p}.$$

Шаг 2. Считаem по **классической формуле**  $t$ -статистику

$$ADF = \frac{\hat{\beta} - 0}{se(\hat{\beta})}.$$



# ADF с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию**

$$\widehat{\Delta y_t} = \hat{c} + \hat{\beta}y_{t-1} + \hat{d}_1\Delta y_{t-1} + \dots + \hat{d}_p\Delta y_{t-p}.$$

Шаг 2. Считаем по **классической формуле**  $t$ -статистику

$$ADF = \frac{\hat{\beta} - 0}{se(\hat{\beta})}.$$

При верной  $H_0$  распределение  $ADF$ -статистики стремится к **особому распределению**  $DF^c$ !

# ADF с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию**

$$\widehat{\Delta y_t} = \hat{c} + \hat{\beta} y_{t-1} + \hat{d}_1 \Delta y_{t-1} + \dots + \hat{d}_p \Delta y_{t-p}.$$

Шаг 2. Считаem по **классической формуле**  $t$ -статистику

$$ADF = \frac{\hat{\beta} - 0}{se(\hat{\beta})}.$$

При верной  $H_0$  распределение  $ADF$ -статистики стремится к **особому распределению**  $DF^c$ !

Шаг 3. Делаем вывод:

Если  $ADF < DF^c$ , то  $H_0$  отвергается.

# ADF без константы

$$\Delta y_t = \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

# ADF без константы

$$\Delta y_t = \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$(\Delta y_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(\Delta y_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + \sum_{i=1}^t \Delta y_i;$$

# ADF без константы

$$\Delta y_t = \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$(\Delta y_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(\Delta y_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + \sum_{i=1}^t \Delta y_i;$$

$$H_a: \beta < 0;$$

$(y_t)$  — стационарный  $AR(p+1)$  процесс с  $\mathbb{E}(y_t) = 0$ ;

# ADF без константы

$$\Delta y_t = \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$(\Delta y_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(\Delta y_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + \sum_{i=1}^t \Delta y_i;$$

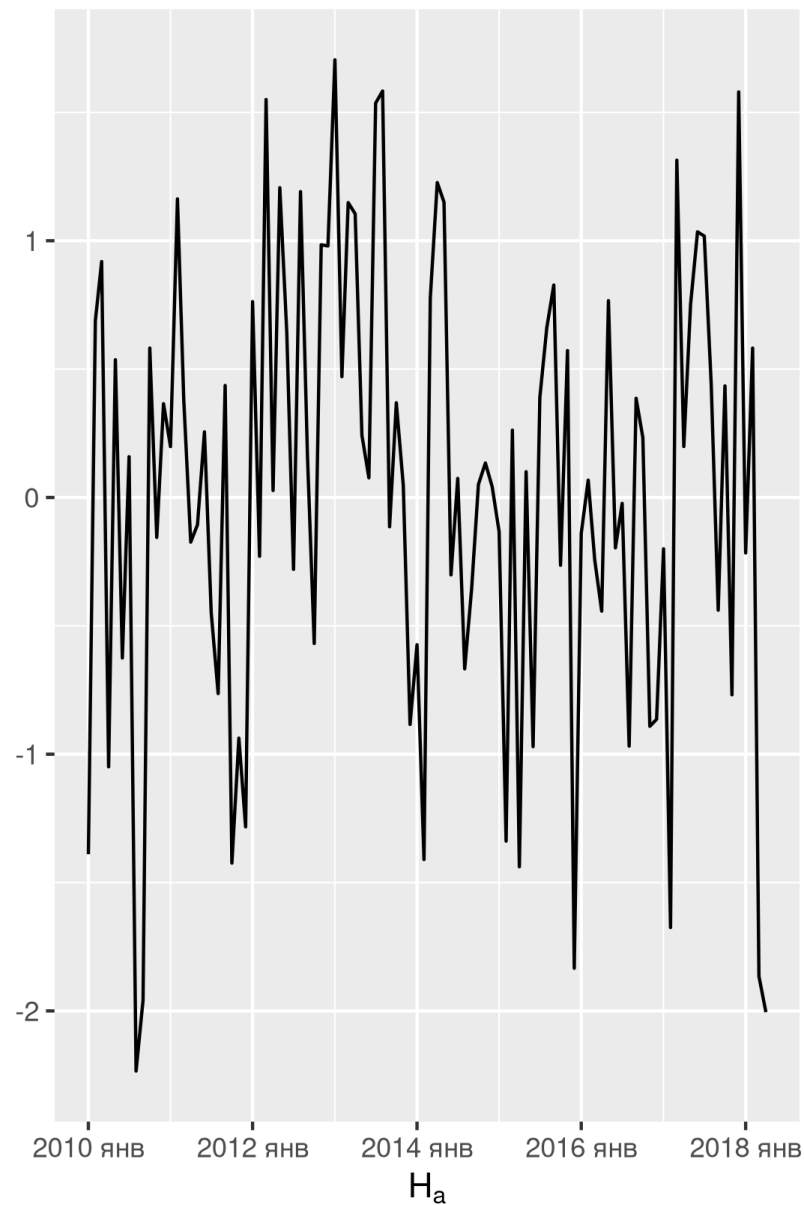
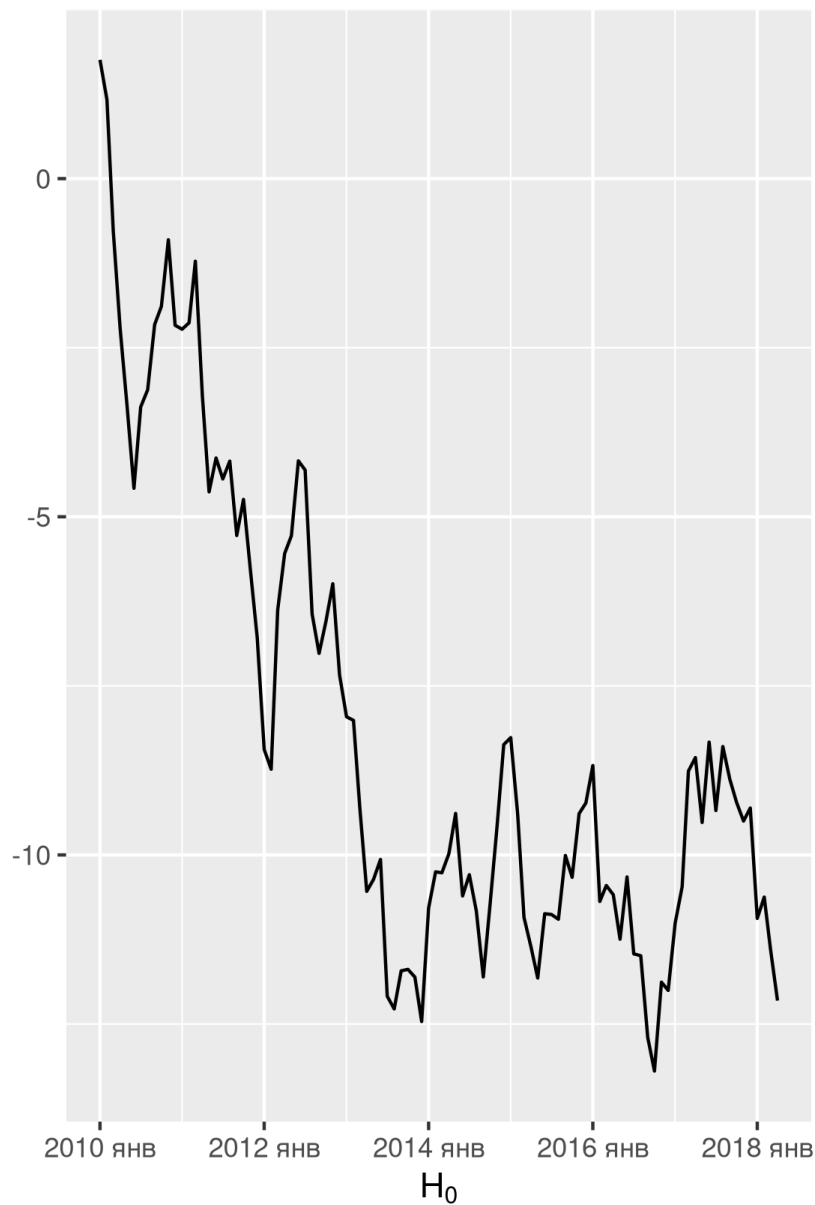
$$H_a: \beta < 0;$$

$(y_t)$  — стационарный  $AR(p+1)$  процесс с  $\mathbb{E}(y_t) = 0$ ;

В алгоритме будет **регрессия без константы** и другое распределение  $DF^0$ .

# ADF без константы: $H_0$ и $H_a$

ADF без константы



# ADF с трендом

$$\Delta y_t = c + gt + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$



# ADF с трендом

$$\Delta y_t = c + gt + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$$\Delta y_t = k_1 + k_2 t + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + m_1 t + m_2 t^2 + \sum_{i=1}^t x_i;$$

# ADF с трендом

$$\Delta y_t = c + gt + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$$\Delta y_t = k_1 + k_2 t + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + m_1 t + m_2 t^2 + \sum_{i=1}^t x_i;$$

$$H_a: \beta < 0;$$

$$y_t = m_1 + m_2 t + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p + 1)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

# ADF с трендом

$$\Delta y_t = c + gt + \beta y_{t-1} + d_1 \Delta y_{t-1} + \dots + d_p \Delta y_{t-p} + u_t,$$

$$H_0: \beta = 0;$$

$$\Delta y_t = k_1 + k_2 t + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$y_t = y_0 + m_1 t + m_2 t^2 + \sum_{i=1}^t x_i;$$

$$H_a: \beta < 0;$$

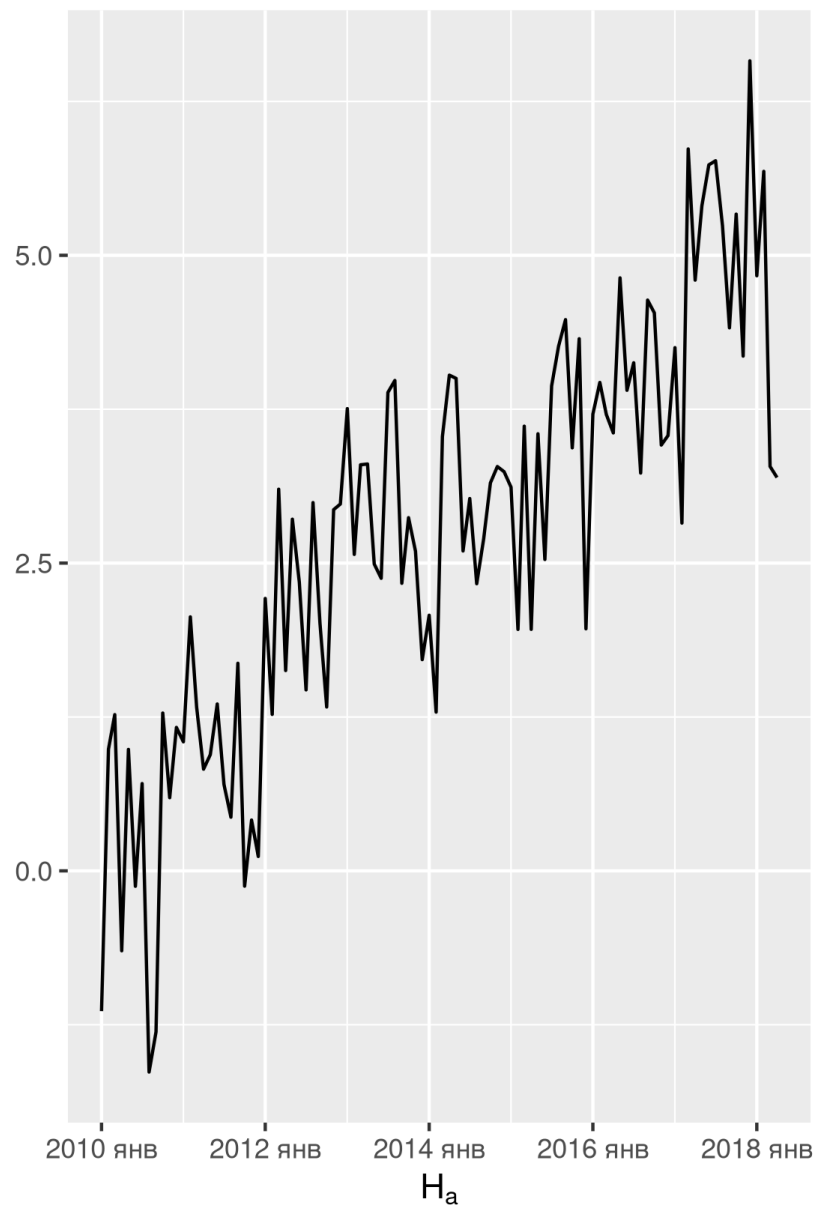
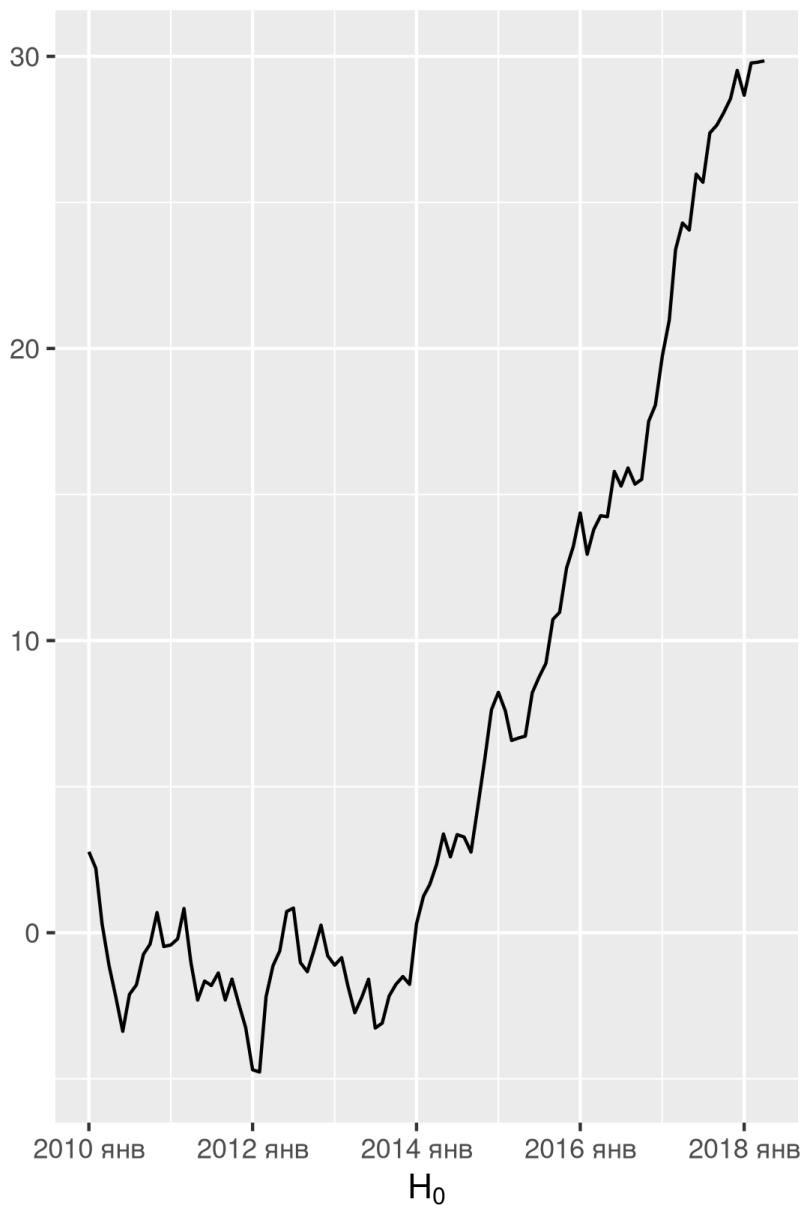
$$y_t = m_1 + m_2 t + x_t;$$

$(x_t)$  — стационарный  $AR(p + 1)$  процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

В алгоритме будет регрессия с константой и трендом и другое распределение  $DF^{ct}$ .

# ADF с трендом: $H_0$ и $H_a$

ADF с трендом



# *ADF* тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к  $\Delta y_t$ .

# *ADF* тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к  $\Delta y_t$ .
- Есть три варианта теста с разными предпосылками.

**KPSS** тест

# KPSS тест: план

- Долгосрочная дисперсия.



# KPSS тест: план

- Долгосрочная дисперсия.
- Предпосылки теста.

# KPSS тест: план

- Долгосрочная дисперсия.
- Предпосылки теста.
- Две вариации теста.

# Зачем нужен KPSS тест?

Хотим ответить на вопросы:

# Зачем нужен KPSS тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать *ARMA* модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?

# Зачем нужен KPSS тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать *ARMA* модель для  $(y_t)$  или для  $(\Delta y_t)$ ?
- Как включать константу в модель?

# KPSS тест

## Расшифровка

Kwiatkowski–Phillips–Schmidt–Shin test

Тест Квятковского-Филлипса-Шмидта-Шина

# KPSS тест

## Расшифровка

Kwiatkowski–Phillips–Schmidt–Shin test

Тест Квятковского-Филлипса-Шмидта-Шина

Две вариации теста: с константой, с трендом.

# Долгосрочная дисперсия

## Определение

Для стационарного процесса  $(y_t)$  величина  $\lambda^2$  называется **долгосрочной дисперсией**, если

$$\text{Var}(\bar{y}) = \frac{\lambda^2}{T} + o(1/T)$$

или

$$\lim_{T \rightarrow \infty} T \text{Var}(\bar{y}) = \lambda^2,$$

где  $\bar{y} = (y_1 + \dots + y_T)/T$ .



# Долгосрочная дисперсия

## Определение

Для стационарного процесса  $(y_t)$  величина  $\lambda^2$  называется **долгосрочной дисперсией**, если

$$\text{Var}(\bar{y}) = \frac{\lambda^2}{T} + o(1/T)$$

или

$$\lim_{T \rightarrow \infty} T \text{Var}(\bar{y}) = \lambda^2,$$

где  $\bar{y} = (y_1 + \dots + y_T)/T$ .

## Мотивация

Для независимых наблюдений с одинаковой дисперсией

$$\text{Var}(\bar{y}) = \frac{\sigma^2}{T}, \text{ где } \sigma^2 = \text{Var}(y_i).$$

# KPSS с константой

$$y_t = c + rw_t + x_t,$$

# KPSS с константой

$$y_t = c + rw_t + x_t,$$

$$H_0: rw_t = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

# KPSS с константой

$$y_t = c + rw_t + x_t,$$

$$H_0: rw_t = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$H_a: rw_t = rw_{t-1} + u_t;$$

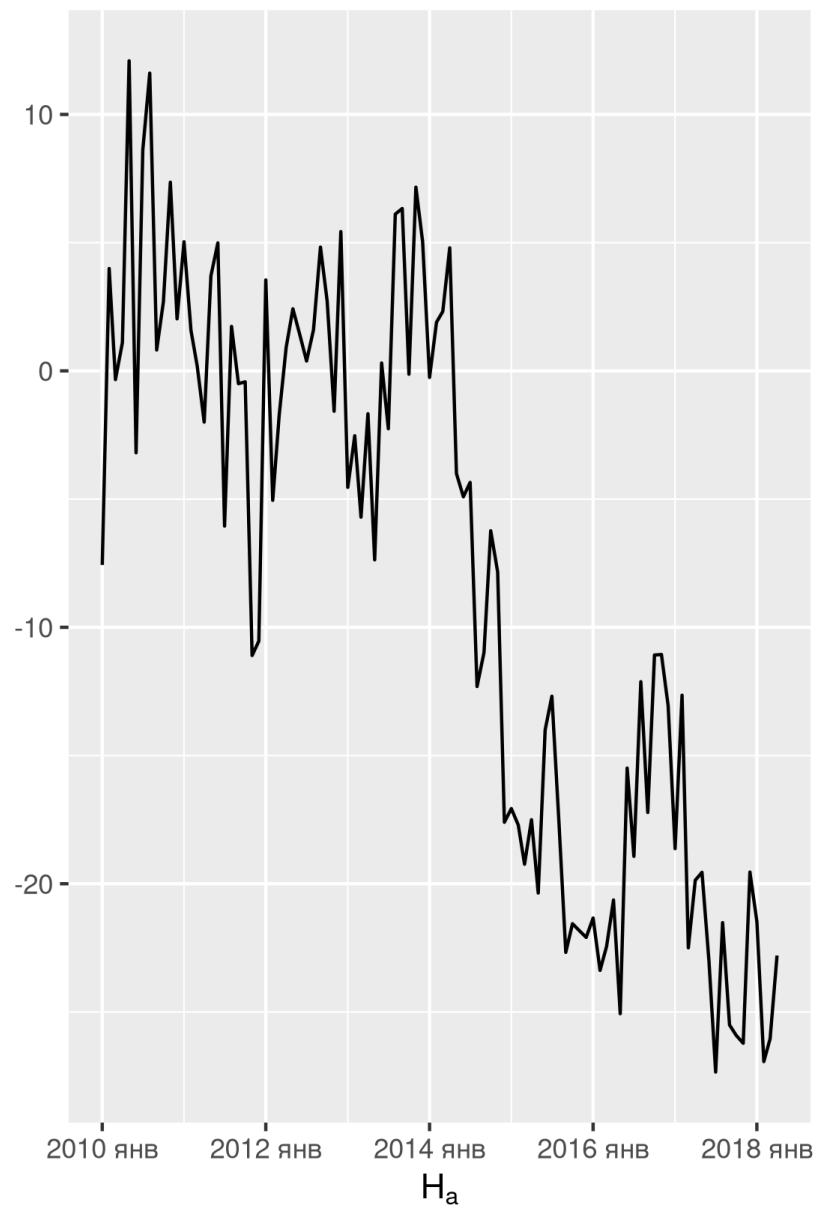
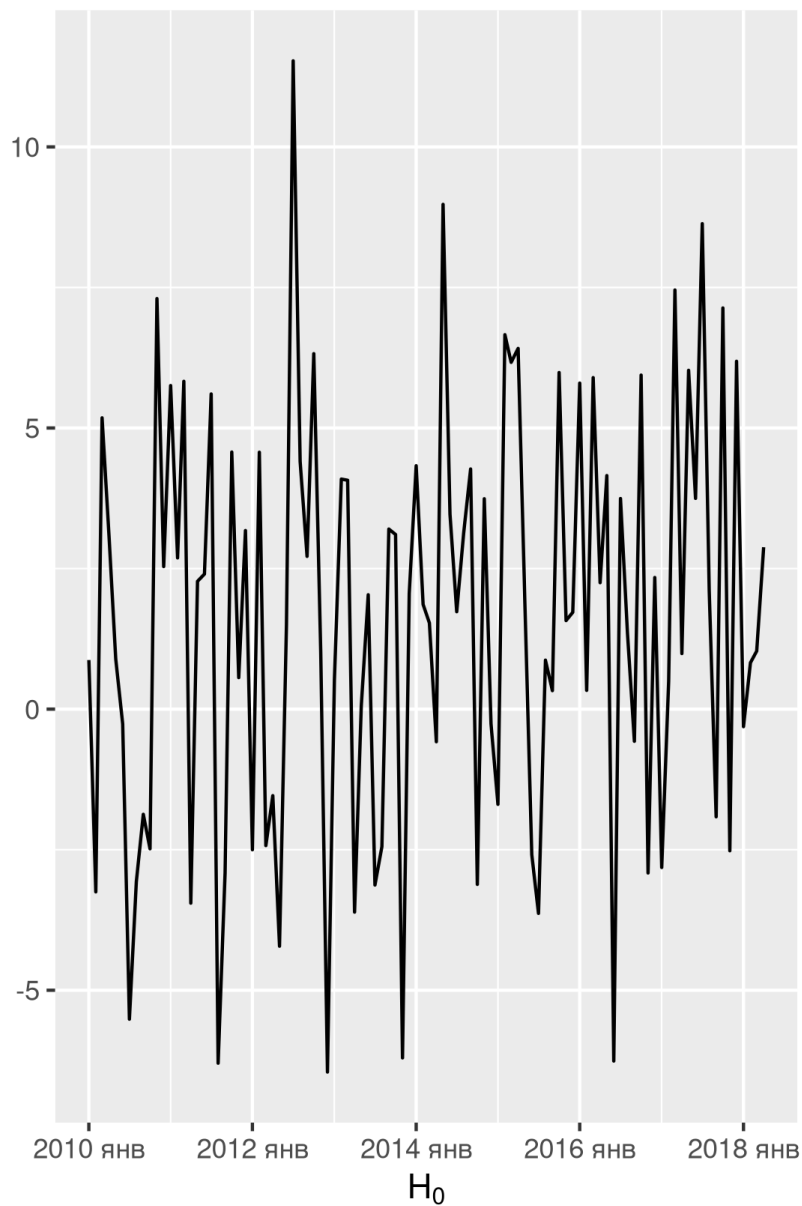
$$rw_0 = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$(u_t)$  — белый шум, независимый с  $(x_t)$ .

# KPSS с константой: $H_0$ и $H_a$

KPSS с константой



# KPSS с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем регрессию на константу

$$\hat{y}_t = \hat{c}.$$

# KPSS с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем регрессию на константу

$$\hat{y}_t = \hat{c}.$$

Шаг 2. Считаем  $KPSS$  статистику

$$KPSS = \frac{\sum_{t=1}^T S_t^2}{T^2 \hat{\lambda}^2},$$

где  $S_t$  — накопленная сумма остатков,  $S_t = \hat{u}_1 + \dots + \hat{u}_t$ ,  
а  $\hat{\lambda}^2$  — состоятельная оценка долгосрочной дисперсии.

# KPSS с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию на константу**

$$\hat{y}_t = \hat{c}.$$

Шаг 2. Считаем *KPSS* статистику

$$KPSS = \frac{\sum_{t=1}^T S_t^2}{T^2 \hat{\lambda}^2},$$

где  $S_t$  — накопленная сумма остатков,  $S_t = \hat{u}_1 + \dots + \hat{u}_t$ ,

а  $\hat{\lambda}^2$  — состоятельная оценка долгосрочной дисперсии.

При верной  $H_0$  распределение *KPSS*-статистики стремится к **особому распределению** *KPSS*<sup>c</sup>!



# KPSS с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию на константу**

$$\hat{y}_t = \hat{c}.$$

Шаг 2. Считаем  $KPSS$  статистику

$$KPSS = \frac{\sum_{t=1}^T S_t^2}{T^2 \hat{\lambda}^2},$$

где  $S_t$  — накопленная сумма остатков,  $S_t = \hat{u}_1 + \dots + \hat{u}_t$ ,  
а  $\hat{\lambda}^2$  — состоятельная оценка долгосрочной дисперсии.

При верной  $H_0$  распределение  $KPSS$ -статистики стремится к **особому распределению**  $KPSS^c$ !

Шаг 3. Делаем вывод:

Если  $KPSS > KPSS^c$ , то  $H_0$  отвергается.

# KPSS с трендом

$$y_t = c + bt + rw_t + x_t,$$

# KPSS с трендом

$$y_t = c + bt + rw_t + x_t,$$

$$H_0: rw_t = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

# KPSS с трендом

$$y_t = c + bt + rw_t + x_t,$$

$$H_0: rw_t = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$H_a: rw_t = rw_{t-1} + u_t;$$

$$rw_0 = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$(u_t)$  — белый шум, независимый с  $(x_t)$ .

# KPSS с трендом

$$y_t = c + bt + rw_t + x_t,$$

$$H_0: rw_t = 0;$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$$H_a: rw_t = rw_{t-1} + u_t;$$

$$rw_0 = 0;$$

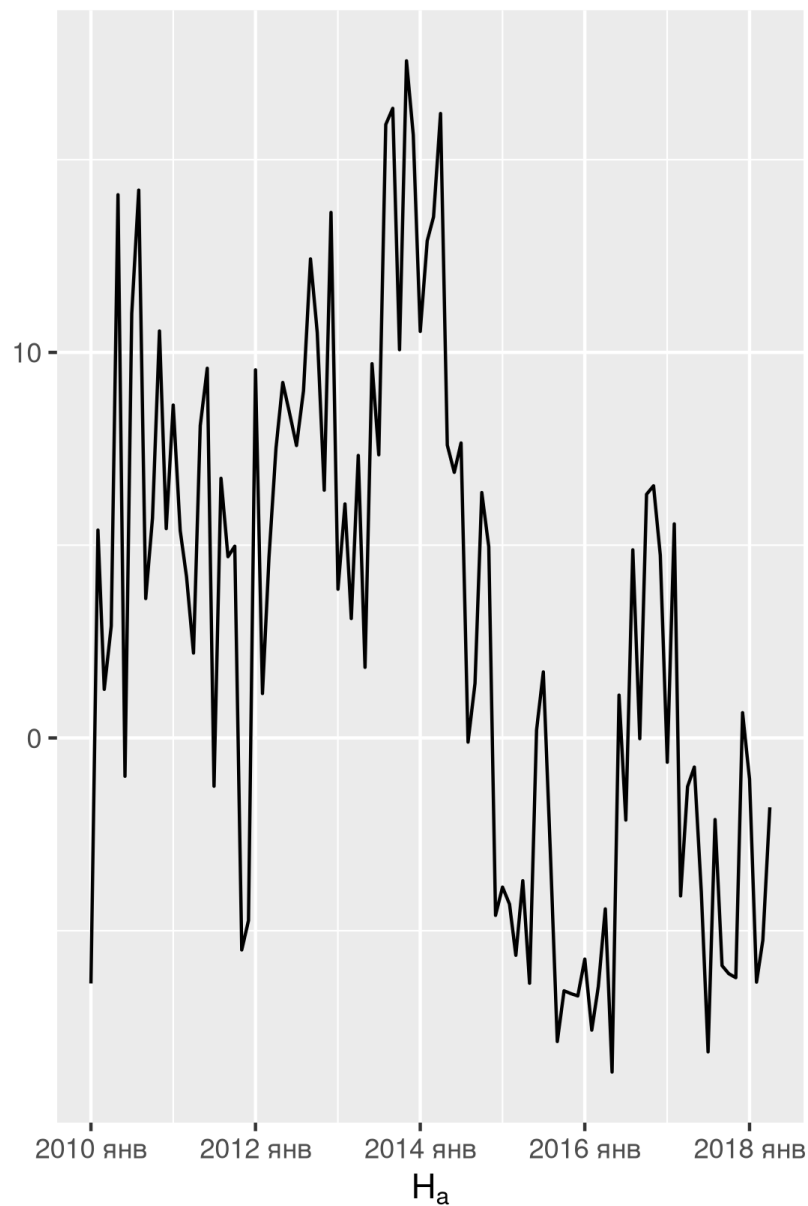
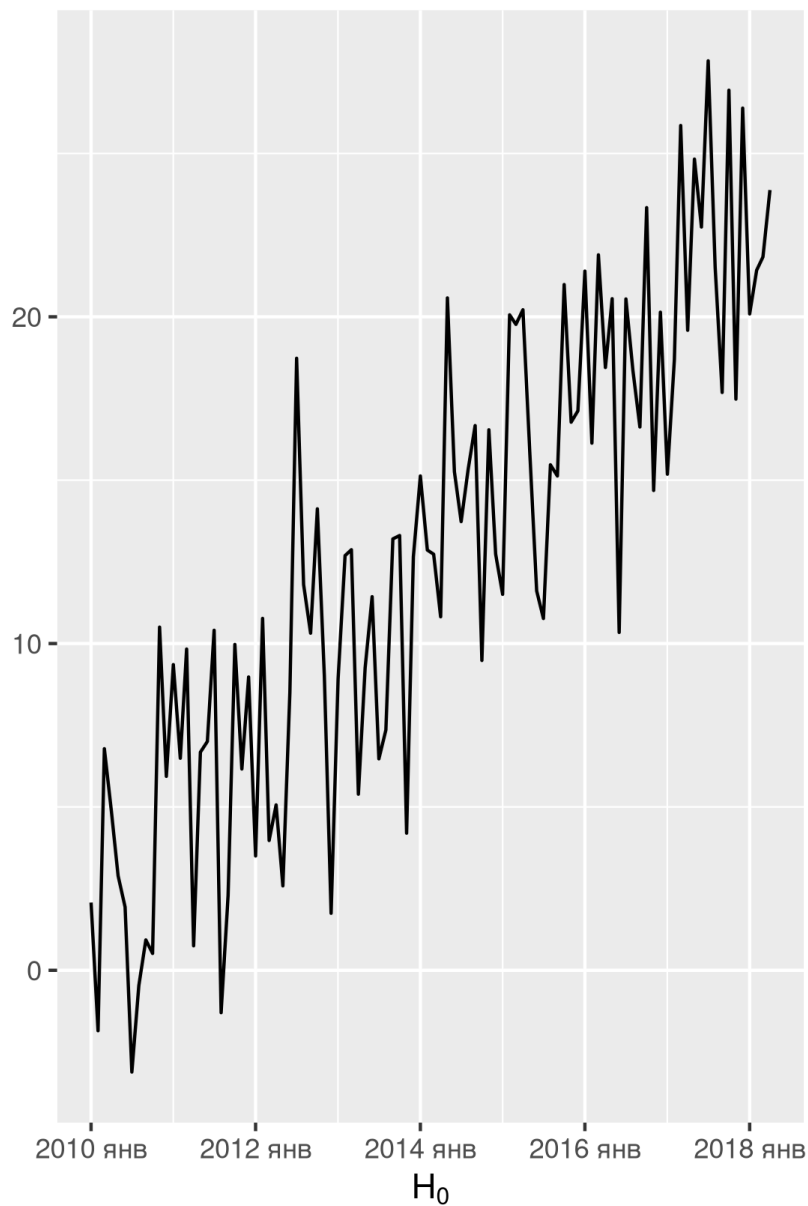
$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ ;

$(u_t)$  — белый шум, независимый с  $(x_t)$ .

В алгоритме будет регрессия с константой и трендом и другое распределение  $KPSS^{ct}$ .

# *KPSS* с трендом: $H_0$ и $H_a$

KPSS с трендом



# Устоявшаяся терминология:

$$A. \quad y_t = a + bt + x_t;$$

$(y_t)$  — стационарный вокруг тренда (trend stationary).

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

# Устоявшаяся терминология:

$$A. \quad y_t = a + bt + x_t;$$

$(y_t)$  — **стационарный вокруг тренда** (trend stationary).

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

Рецепт: оценим регрессию  $a + bt$  с  $ARMA$  ошибками для  $(y_t)$ .



# Устоявшаяся терминология:

$$A. \quad y_t = a + bt + x_t;$$

$(y_t)$  — **стационарный вокруг тренда** (trend stationary).

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

Рецепт: оценим регрессию  $a + bt$  с *ARMA* ошибками для  $(y_t)$ .

$$B. \quad y_t = a + \sum_{i=1}^t x_i \text{ или } y_t = a + bt + \sum_{i=1}^t x_i$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

$(y_t)$  — **стационарный в разностях** (difference stationary).

# Устоявшаяся терминология:

$$A. \quad y_t = a + bt + x_t;$$

$(y_t)$  — **стационарный вокруг тренда** (trend stationary).

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

Рецепт: оценим регрессию  $a + bt$  с  $ARMA$  ошибками для  $(y_t)$ .

$$B. \quad y_t = a + \sum_{i=1}^t x_i \text{ или } y_t = a + bt + \sum_{i=1}^t x_i$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

$(y_t)$  — **стационарный в разностях** (difference stationary).

Рецепт: оценим  $ARMA$  для  $(\Delta y_t)$ .

# Устоявшаяся терминология:

$$A. \quad y_t = a + bt + x_t;$$

$(y_t)$  — **стационарный вокруг тренда** (trend stationary).

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

Рецепт: оценим регрессию  $a + bt$  с  $ARMA$  ошибками для  $(y_t)$ .

$$B. \quad y_t = a + \sum_{i=1}^t x_i \text{ или } y_t = a + bt + \sum_{i=1}^t x_i$$

$(x_t)$  — стационарный процесс с  $\mathbb{E}(x_t) = 0$ .

$(y_t)$  — **стационарный в разностях** (difference stationary).

Рецепт: оценим  $ARMA$  для  $(\Delta y_t)$ .

Оба  $(y_t)$  нестационарны!

# *KPSS* тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к  $\Delta y_t$ .

# *KPSS* тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к  $\Delta y_t$ .
- Есть два варианта теста с разными предпосылками.

# Сезонная ARIMA

# Сезонная ARIMA: план

- ARMA должна быть экономной!

# Сезонная ARIMA: план

- ARMA должна быть экономной!
- Сезонные полиномы.



# Сезонная ARIMA: план

- ARMA должна быть экономной!
- Сезонные полиномы.
- Нужно ли переходить к сезонным разностям?

# Сезонность и *ARIMA*

С помощью *ARMA* и *ARIMA* моделей можно моделировать сезонность!

# Сезонность и *ARIMA*

С помощью *ARMA* и *ARIMA* моделей можно моделировать сезонность!

Только **дорого!**

# Сезонность и *ARIMA*

С помощью *ARMA* и *ARIMA* моделей можно моделировать сезонность!

Только **дорого!**

$$MA(12) : y_t = c + u_t + a_1 u_{t-1} + a_2 u_{t-2} + \dots + a_{12} u_{t-12}.$$

$$ARIMA(12, 1, 0) : \Delta y_t = c + u_t + b_1 \Delta y_{t-1} + \dots + b_{12} \Delta y_{t-12}.$$

# ARMA должна быть экономной!

Сосредоточимся на коэффициентах **сильнее отличных** от нуля!

# ARMA должна быть экономной!

Сосредоточимся на коэффициентах **сильнее отличных** от нуля!

## Определение

Если стационарную *ARMA* модель для  $y_t$  можно записать с меньшим числом параметров в виде

$$P_{non}(L)P_{seas}(L^{12})y_t = c + Q_{non}(L)Q_{seas}(L^{12})u_t,$$

где степени у лаговых полиномов равны  $\deg P_{non} = p$ ,  $\deg P_{seas} = P$ ,  $\deg Q_{non} = q$ ,  $\deg Q_{seas} = Q$ , то она также называется *SARMA*( $p, q$ )( $P, Q$ )[12].

# Примеры

- $SARMA(1, 0)(0, 2)[12]$

$$(1 - b_1 L)y_t = c + (1 + d_1 L^{12} + d_2 L^{24})u_t;$$

# Примеры

- $SARMA(1, 0)(0, 2)[12]$

$$(1 - b_1 L)y_t = c + (1 + d_1 L^{12} + d_2 L^{24})u_t;$$

- $SARMA(0, 2)(1, 0)[12]$

$$(1 - f_1 L^{12})y_t = c + (1 + a_1 L + a_2 L^2)u_t;$$



# Примеры

- $SARMA(1, 0)(0, 2)[12]$

$$(1 - b_1 L)y_t = c + (1 + d_1 L^{12} + d_2 L^{24})u_t;$$

- $SARMA(0, 2)(1, 0)[12]$

$$(1 - f_1 L^{12})y_t = c + (1 + a_1 L + a_2 L^2)u_t;$$

- $SARMA(1, 2)(2, 1)[12]$

$$(1 - f_1 L^{12} - f_2 L^{24})(1 - b_1 L^1)y_t = c + (1 + a_1 L + a_2 L^2)(1 + d_1 L^{12})u_t$$

# SARIMA

По аналогии с разностью  $\Delta y_t = y_t - y_{t-1}$  можно рассмотреть сезонную разность  $\Delta_{12} y_t = y_t - y_{t-12}$ .

# SARIMA

По аналогии с разностью  $\Delta y_t = y_t - y_{t-1}$  можно рассмотреть сезонную разность  $\Delta_{12} y_t = y_t - y_{t-12}$ .

## Определение

Если ряд  $z_t = \Delta^d \Delta_{12}^D y_t$  описывается стационарной моделью  $SARMA(p, q)(P, Q)[12]$ , то говорят, что  $y_t$  описывается моделью  $SARIMA(p, d, q)(P, D, Q)[12]$ .

По аналогии с разностью  $\Delta y_t = y_t - y_{t-1}$  можно рассмотреть сезонную разность  $\Delta_{12} y_t = y_t - y_{t-12}$ .

## Определение

Если ряд  $z_t = \Delta^d \Delta_{12}^D y_t$  описывается стационарной моделью  $SARMA(p, q)(P, Q)[12]$ , то говорят, что  $y_t$  описывается моделью  $SARIMA(p, d, q)(P, D, Q)[12]$ .

$d$  — количество взятий обычной разности  $\Delta = 1 - L$ ;

$D$  — количество взятий сезонной разности  $\Delta_{12} = 1 - L^{12}$ ;

# SARIMA

По аналогии с разностью  $\Delta y_t = y_t - y_{t-1}$  можно рассмотреть сезонную разность  $\Delta_{12} y_t = y_t - y_{t-12}$ .

## Определение

Если ряд  $z_t = \Delta^d \Delta_{12}^D y_t$  описывается стационарной моделью  $SARMA(p, q)(P, Q)[12]$ , то говорят, что  $y_t$  описывается моделью  $SARIMA(p, d, q)(P, D, Q)[12]$ .

$d$  — количество взятий обычной разности  $\Delta = 1 - L$ ;

$D$  — количество взятий сезонной разности  $\Delta_{12} = 1 - L^{12}$ ;

$y_t \sim SARIMA(0, 0, 2)(1, 1, 2)[12]$  означает, что

$$\Delta_{12} y_t \sim SARMA(0, 2)(1, 2)[12]$$

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на график!

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на график!

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .



# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на **график!**

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на **график!**

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на график!

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по кросс-валидации.

Затратно по времени!

- Применять  $AIC$  нельзя!

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на **график!**

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

Условная и безусловная функции правдоподобия содержат разное число слагаемых.

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на **график!**

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

Условная и безусловная функции правдоподобия содержат разное число слагаемых.

- Есть **тесты на единичный корень!**

# Как выбрать?

$SARIMA(p, 0, q)(P, 0, Q)$  или  $SARIMA(p, 0, q)(P, 1, Q)$ [12]?

- Посмотреть на **график!**

Слишком выраженная сезонность — повод перейти к  $\Delta_{12}y_t$ .

- Оценить все эти модели и выбрать наилучшую по **кросс-валидации**.

Затратно по времени!

- **Применять  $AIC$  нельзя!**

Условная и безусловная функции правдоподобия содержат разное число слагаемых.

- Есть **тесты на единичный корень!**

И эмпирические правила...

# STL разложение и сила сезонности

Шаг 1. Находим *STL* разложение ряда  $(y_t)$ .

$$y_t = trend_t + seas_t + remainder_t$$

# STL разложение и сила сезонности

Шаг 1. Находим  $STL$  разложение ряда  $(y_t)$ .

$$y_t = trend_t + seas_t + remainder_t$$

Шаг 2. Рассчитываем силу сезонности.

$$F_{seas} = \max \left\{ 1 - \frac{sVar(remainder)}{sVar(seas + remainder)}, 0 \right\}.$$



# STL разложение и сила сезонности

Шаг 1. Находим  $STL$  разложение ряда  $(y_t)$ .

$$y_t = trend_t + seas_t + remainder_t$$

Шаг 2. Рассчитываем силу сезонности.

$$F_{seas} = \max \left\{ 1 - \frac{sVar(remainder)}{sVar(seas + remainder)}, 0 \right\}.$$

Шаг 3. Если сила сезонности выше порога, то переходим к

$$\Delta_{12}y_t = y_t - y_{t-12}.$$

# Сезонная ARIMA: итоги

- Сезонная ARIMA **экономит** параметры.

# Сезонная ARIMA: итоги

- Сезонная ARIMA **экономит** параметры.
- Сила сезонности из **STL** разложения используется для решения о необходимости сезонной разности  $\Delta_{12}y_t$ .

# **Алгоритм Хандакара-Хиндмана**

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: план

- Три шага алгоритма.

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: план

- Три шага алгоритма.
- Нюансы и рекомендации.

**Как всё это собрать в кучу?**

# Как всё это собрать в кучу?

Шаг 1 (для сезонных рядов). Сколько раз надо брать  $\Delta_{12}$ ?



# Как всё это собрать в кучу?

Шаг 1 (для сезонных рядов). Сколько раз надо брать  $\Delta_{12}$ ?

Шаг 2. Сколько раз надо брать  $\Delta$ ?

# Как всё это собрать в кучу?

Шаг 1 (для сезонных рядов). Сколько раз надо брать  $\Delta_{12}$ ?

Шаг 2. Сколько раз надо брать  $\Delta$ ?

Шаг 3. Какую стационарную *SARMA* модель оценивать после взятия разностей?

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.
- Если сила сезонности меньше пороговой, то работаем с исходным рядом  $y_t$ .

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.
- Если сила сезонности меньше пороговой, то работаем с исходным рядом  $y_t$ .
- Если сила больше пороговой, то переходим к сезонной разности и после нового  $STL$  разложения сравниваем силу сезонности с пороговой ещё раз.

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.
- Если сила сезонности меньше пороговой, то работаем с исходным рядом  $y_t$ .
- Если сила больше пороговой, то переходим к сезонной разности и после нового  $STL$  разложения сравниваем силу сезонности с пороговой ещё раз.
- Если сила сезонности снова больше пороговой, то работаем с  $\Delta_{12}^2 y_t$ , иначе работаем с  $\Delta_{12} y_t$ .

# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.
- Если сила сезонности меньше пороговой, то работаем с исходным рядом  $y_t$ .
- Если сила больше пороговой, то переходим к сезонной разности и после нового  $STL$  разложения сравниваем силу сезонности с пороговой ещё раз.
- Если сила сезонности снова больше пороговой, то работаем с  $\Delta_{12}^2 y_t$ , иначе работаем с  $\Delta_{12} y_t$ .



# Шаг 1. Сколько раз надо брать $\Delta_{12}$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим  $STL$  разложение ряда.
- Если сила сезонности меньше пороговой, то работаем с исходным рядом  $y_t$ .
- Если сила больше пороговой, то переходим к сезонной разности и после нового  $STL$  разложения сравниваем силу сезонности с пороговой ещё раз.
- Если сила сезонности снова больше пороговой, то работаем с  $\Delta_{12}^2 y_t$ , иначе работаем с  $\Delta_{12} y_t$ .

Есть альтернатива в виде теста Канова-Хансена (Canova-Hansen).

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\triangle$ ?

Ни разу, раз или два раза.

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.
- Если  $H_0$  не отвергается, то работаем с рядом  $y_t$ .

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.
- Если  $H_0$  не отвергается, то работаем с рядом  $y_t$ .
- Если  $H_0$  отвергается, то проводим  $KPSS$  тест для разности  $\Delta y_t$ .

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.
- Если  $H_0$  не отвергается, то работаем с рядом  $y_t$ .
- Если  $H_0$  отвергается, то проводим  $KPSS$  тест для разности  $\Delta y_t$ .
- Если у повторного  $KPSS$  теста  $H_0$  отвергается, то работаем с  $\Delta^2 y_t$  иначе работаем с  $\Delta y_t$ .

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.
- Если  $H_0$  не отвергается, то работаем с рядом  $y_t$ .
- Если  $H_0$  отвергается, то проводим  $KPSS$  тест для разности  $\Delta y_t$ .
- Если у повторного  $KPSS$  теста  $H_0$  отвергается, то работаем с  $\Delta^2 y_t$  иначе работаем с  $\Delta y_t$ .

## Шаг 2. Сколько раз надо брать $\Delta$ ?

Ни разу, раз или два раза.

- Применяем  $KPSS$  тест с константой к исходному ряду.
- Если  $H_0$  не отвергается, то работаем с рядом  $y_t$ .
- Если  $H_0$  отвергается, то проводим  $KPSS$  тест для разности  $\Delta y_t$ .
- Если у повторного  $KPSS$  теста  $H_0$  отвергается, то работаем с  $\Delta^2 y_t$  иначе работаем с  $\Delta y_t$ .

Есть альтернатива в виде  $ADF$  теста.



## Шаг 3. Выбор $SARMA$ модели для преобразованного ряда

- Оцениваем большое количество экономных  $SARMA$  моделей.

$$\Delta^d \Delta_{12}^D y_t \sim SARMA(p, q)(P, Q)[12], p + q \leq 5, P + Q \leq 5$$

# Шаг 3. Выбор $SARMA$ модели для преобразованного ряда

- Оцениваем большое количество экономных  $SARMA$  моделей.

$$\Delta^d \Delta_{12}^D y_t \sim SARMA(p, q)(P, Q)[12], p + q \leq 5, P + Q \leq 5$$

- Выбираем наилучшую модель по штрафному критерию Акаике:

$AIC = 2K - 2 \ln L$ , где  $K$  — общее число параметров,  $\ln L$  — логарифм правдоподобия.

# Шаг 3. Выбор $SARMA$ модели для преобразованного ряда

- Оцениваем большое количество экономных  $SARMA$  моделей.

$$\Delta^d \Delta_{12}^D y_t \sim SARMA(p, q)(P, Q)[12], p + q \leq 5, P + Q \leq 5$$

- Выбираем наилучшую модель по штрафному критерию Акаике:

$AIC = 2K - 2 \ln L$ , где  $K$  — общее число параметров,  $\ln L$  — логарифм правдоподобия.

# Шаг 3. Выбор $SARMA$ модели для преобразованного ряда

- Оцениваем большое количество экономных  $SARMA$  моделей.

$$\Delta^d \Delta_{12}^D y_t \sim SARMA(p, q)(P, Q)[12], p + q \leq 5, P + Q \leq 5$$

- Выбираем наилучшую модель по штрафному критерию Акаике:

$$AIC = 2K - 2 \ln L, \text{ где } K \text{ — общее число параметров, } \ln L \text{ — логарифм правдоподобия.}$$

Есть альтернатива в виде перебора с помощью кросс-валидации.

# Методология Бокса-Дженкинсона

- Идентификация подходящей модели.  
Графический анализ, тесты. Выбор количества сезонных и обычных разностей.

# Методология Бокса-Дженкинсона

- Идентификация подходящей модели.  
Графический анализ, тесты. Выбор количества сезонных и обычных разностей.
- Оценивание подходящей модели.  
Оценивание параметров  $SARMA$  модели для преобразованного ряда.

# Методология Бокса-Дженкинсона

- Идентификация подходящей модели.  
Графический анализ, тесты. Выбор количества сезонных и обычных разностей.
- Оценивание подходящей модели.  
Оценивание параметров *SARMA* модели для преобразованного ряда.
- Статистическая проверка модели.  
Визуализация остатков. Тесты на остатки модели.

# Методология Бокса-Дженкинсона

- Идентификация подходящей модели.  
Графический анализ, тесты. Выбор количества сезонных и обычных разностей.
- Оценивание подходящей модели.  
Оценивание параметров *SARMA* модели для преобразованного ряда.
- Статистическая проверка модели.  
Визуализация остатков. Тесты на остатки модели.



# Методология Бокса-Дженкинсона

- Идентификация подходящей модели.  
Графический анализ, тесты. Выбор количества сезонных и обычных разностей.
- Оценивание подходящей модели.  
Оценивание параметров *SARMA* модели для преобразованного ряда.
- Статистическая проверка модели.  
Визуализация остатков. Тесты на остатки модели.

Алгоритм Хандакара-Хиндмана — практическая реализация методологии.

# Нюансы алгоритма

- Очень много опций...

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t \text{ или } P(L)(y_t - \mu) = Q(L)u_t$$

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t \text{ или } P(L)(y_t - \mu) = Q(L)u_t$$

- Требуется **много времени**.

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t \text{ или } P(L)(y_t - \mu) = Q(L)u_t$$

- Требуется **много времени**.

Не стоит использовать кросс-валидацию.

# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t \text{ или } P(L)(y_t - \mu) = Q(L)u_t$$

- Требуется **много времени**.

Не стоит использовать кросс-валидацию.

- Суммирует опыт **десятилетий**.



# Нюансы алгоритма

- Очень **много опций**...

Возможны отличия реализаций в софте.

- Обратите внимание на включение **константы**:

$$P(L)y_t = c + Q(L)u_t \text{ или } P(L)(y_t - \mu) = Q(L)u_t$$

- Требуется **много времени**.

Не стоит использовать кросс-валидацию.

- Суммирует опыт **десятилетий**.

Не забудьте им воспользоваться!

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: итоги

- Шаг 1. Решение о переходе к сезонным разностям.

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: итоги

- Шаг 1. Решение о переходе к сезонным разностям.
- Шаг 2. Решение о переходе к разностям.

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: итоги

- Шаг 1. Решение о переходе к сезонным разностям.
- Шаг 2. Решение о переходе к разностям.
- Шаг 3. Оценка множества  $SARMA$  моделей с выбором по  $AIC$ .

# Алгоритм Хандакара-Хиндмана: итоги

- Шаг 1. Решение о переходе к сезонным разностям.
- Шаг 2. Решение о переходе к разностям.
- Шаг 3. Оценка множества  $SARMA$  моделей с выбором по  $AIC$ .
- Обязательно попробуйте алгоритм!