

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 Δy_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 Δy_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 (Δy_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 Δy_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 (Δy_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 Δy_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 (Δy_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»

четыре небольших графика на одном слайде

явно стационарный (x)

случайное блуждание (y)

явно с трендом (z)

что-то спорное (w)

Буковка I: итоги

- *ARMA* подходит только для стационарных рядов.

Буковка I: итоги

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

Буковка I: итоги

- $ARMA$ подходит только для **стационарных** рядов.
- Иногда стационарен Δy_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 (Δy_t) ?

Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

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

Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

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

Зачем нужен ADF тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать $ARMA$ модель для (y_t) или для (Δy_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 (Δy_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

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

$$H_0: \beta = 0;$$

(Δy_t) — стационарный $AR(p)$ процесс;

$$y_t = y_0 + mt + \sum_{i=1}^t (\Delta y_i - \mathbb{E}(\Delta y_i));$$

ADF с константой

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

$$H_0: \beta = 0;$$

(Δy_t) — стационарный $AR(p)$ процесс;

$$y_t = y_0 + mt + \sum_{i=1}^t (\Delta y_i - \mathbb{E}(\Delta y_i));$$

$$H_a: \beta < 0;$$

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

ADF с константой: H_0 и H_a

тут два графика,

слева H_0

Δy_t — стационарный $AR(p)$ процесс;

$$y_t = y_0 + ct + \sum_{i=1}^t (\Delta y_t - \mathbb{E}(\Delta y_t));$$

справа H_a

y_t — стационарный $AR(p + 1)$ процесс с ненулевым ожиданием

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. Считаем 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. 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 !

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

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

$$H_0: \beta = 0;$$

(Δy_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

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

$$H_0: \beta = 0;$$

(Δy_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

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

$$H_0: \beta = 0;$$

(Δy_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

тут два графика,

слева H_0

справа H_a

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

тут два графика,

слева H_0

справа H_a

ADF тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к Δy_t .

ADF тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к Δy_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 (Δy_t) ?

Зачем нужен KPSS тест?

Хотим ответить на вопросы:

- Использовать *ARMA* модель для (y_t) или для (Δy_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 λ^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 λ^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

тут два графика,

слева H_0

справа H_a

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*^c!

KPSS с константой: алгоритм

Шаг 1. Оцениваем **регрессию на константу**

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

Шаг 2. Считаem $KPSS$ 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

тут два графика,

слева H_0

справа H_a

Устоявшаяся терминология:

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

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

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

Устоявшаяся терминология:

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

(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:

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

(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) .

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

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

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

Устоявшаяся терминология:

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

(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) .

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

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

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

Рецепт: оценим $ARMA$ для (Δy_t) .

Устоявшаяся терминология:

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

(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) .

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

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

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

Рецепт: оценим $ARMA$ для (Δy_t) .

Оба (y_t) нестационарны!

KPSS тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к Δy_t .

KPSS тест: итоги

- Применим для принятия решения о переходе к Δy_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 Δ_{12} ?

Как всё это собрать в кучу?

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

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

Как всё это собрать в кучу?

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

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

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

Шаг 1. Сколько раз надо брать Δ_{12} ?

Ни разу, раз или два раза.

Шаг 1. Сколько раз надо брать Δ_{12} ?

Ни разу, раз или два раза.

- Находим STL разложение ряда.

Шаг 1. Сколько раз надо брать Δ_{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 Δ_{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 Δ_{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 Δ_{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 Δ_{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 Δ ?

Ни разу, раз или два раза.

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

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

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 Δ ?

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 Δy_t .

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

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 Δy_t .
- Если у повторного $KPSS$ теста H_0 отвергается, то работаем с $\Delta^2 y_t$ иначе работаем с Δy_t .

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

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 Δy_t .
- Если у повторного $KPSS$ теста H_0 отвергается, то работаем с $\Delta^2 y_t$ иначе работаем с Δy_t .

Шаг 2. Сколько раз надо брать Δ ?

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 Δy_t .
- Если у повторного $KPSS$ теста H_0 отвергается, то работаем с $\Delta^2 y_t$ иначе работаем с Δy_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!