



# Analiza și Prognoza Seriilor de Timp

## Capitolul 4: Modele SARIMA pentru Serii de Timp Sezoniere



Daniel Traian PELE

Academia de Studii Economice din București

IDA Institute Digital Assets

Blockchain Research Center

AI4EFin Artificial Intelligence for Energy Finance

Academia Română, Institutul de Prognoză Economică

MSCA Digital Finance

## Obiective de învățare

La finalul acestui capitol, veți putea:

- ▣ Identifica tiparele sezoniere în datele de tip serie de timp
- ▣ Aplica diferențierea sezonieră pentru a elimina rădăcinile unitare sezoniere
- ▣ Construi și estima modele SARIMA cu componente sezoniere
- ▣ Produce prognoze precise pentru serii temporale sezoniere

## Structura cursului

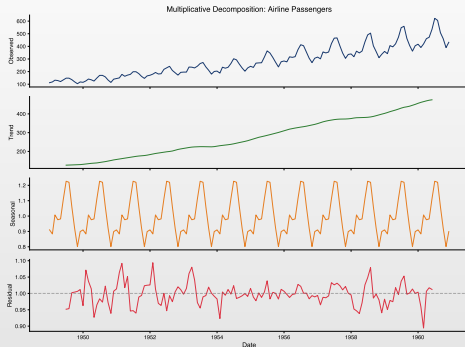
- ▣ Motivație
- ▣ Sezonalitatea în seriile de timp
- ▣ Diferențierea sezonieră
- ▣ Modelul SARIMA
- ▣ Tipare ACF și PACF sezoniere
- ▣ Estimare și validare
- ▣ Prognoza cu SARIMA
- ▣ Studiu de caz: Număr de pasageri
- ▣ Rezumat

## De ce SARIMA? Sezonalitatea este peste tot



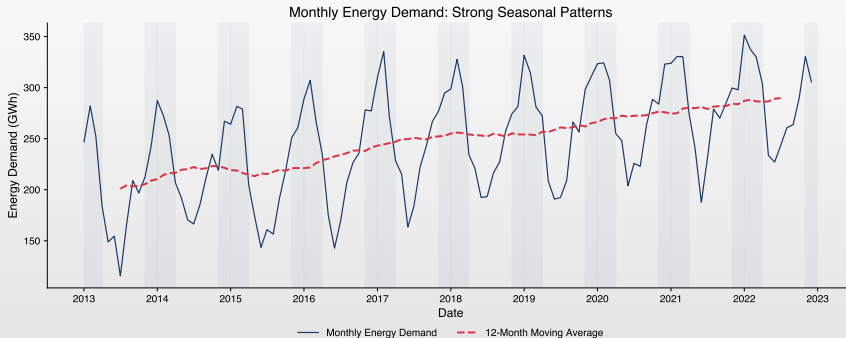
- Vânzările cu amănuntul prezintă **tipare anuale** clare: vârfuri în decembrie, minime în ianuarie
- Modelele ARIMA standard nu pot captura aceste **cicluri sezoniere repetitive**
- Ignorarea sezonality duce la erori sistematice de prognoză

## Înțelegerea componentelor sezoniere



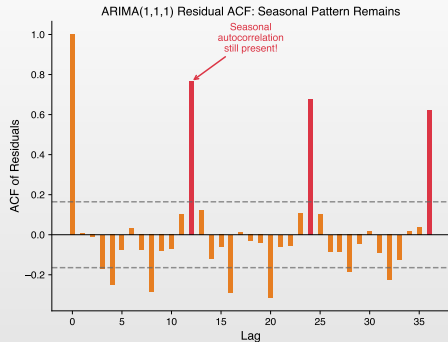
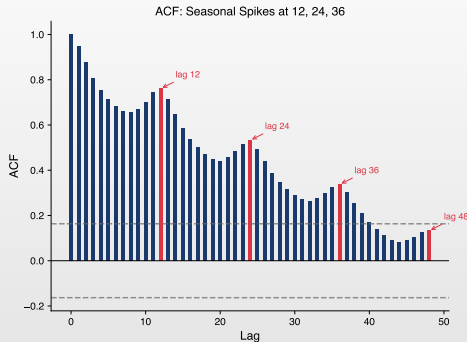
- Serie de timp sezonieră = **Trend + Tipar sezonier + Reziduuri**
- Descompunerea ajută la vizualizarea separată a fiecărei componente
- Modelele SARIMA captează atât dinamica trendului, cât și comportamentul sezonier

## Aplicație reală: Tipare lunare



- Cererea de energie prezintă o **sezonalitate lunară** puternică (cicluri de încălzire/răcire)
- Tiparul se repetă previzibil în fiecare an cu mici variații
- Companiile de utilități folosesc prognozele SARIMA pentru planificarea capacității

## De ce avem nevoie de SARIMA?



- **Stânga:** ACF sezonieră prezintă vârfuri la lag-urile 12, 24, 36... (tipar anual)
- **Dreapta:** Reziduurile ARIMA încă prezintă autocorelație sezonieră  $\curvearrowright$  modelul este incomplet
- SARIMA adaugă **termeni AR și MA sezonieri** pentru a captura aceste tipare

## Ce vom învăța astăzi

### Concepte

- ▣ Identificarea tiparelor sezoniere
- ▣ Operatorul de diferențiere sezonieră
- ▣ Notația  $SARIMA(p, d, q)(P, D, Q)_s$
- ▣ Celebrul “Model Airline”
- ▣ Selecția modelului pentru date sezoniere

### Abilități

- ▣ Detectarea sezonality din ACF/PACF
- ▣ Determinarea perioadei sezoniere  $s$
- ▣ Alegerea ordinilor sezoniere  $(P, D, Q)$
- ▣ Implementarea SARIMA în Python/R
- ▣ Prognoza seriilor de timp sezoniere

### Ideea cheie

- ▣ SARIMA = ARIMA aplicată la **două frecvențe**: non-sezonieră (termen scurt) și sezonieră (termen lung)



## Ce este sezonalitatea?

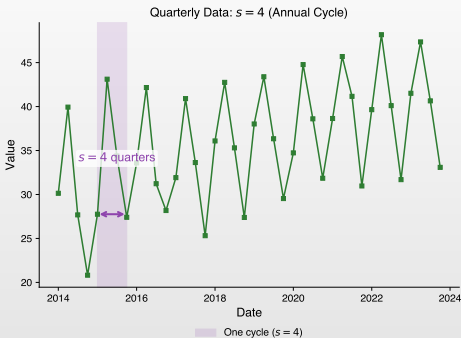
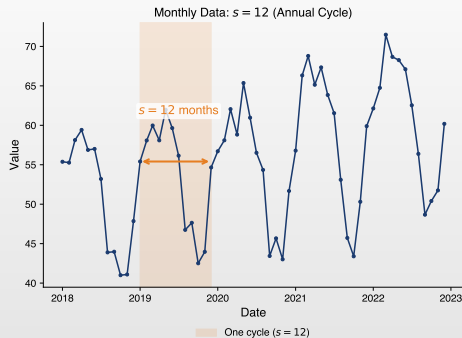
### Definiție 1 (Sezonalitate)

- O serie de timp prezintă **sezonalitate** când arată fluctuații regulate, periodice care se repetă pe o perioadă fixă  $s$  (perioadă sezonieră)

### Perioade sezoniere comune

- Date lunare:  $s = 12$  (ciclu anual)
- Date trimestriale:  $s = 4$  (ciclu anual)
- Date săptămânale:  $s = 52$  (anual) sau  $s = 7$  (tipar săptămânal)
- Date zilnice:  $s = 7$  (tipar săptămânal)

## Sezonalitatea: Ilustrare vizuală



- **Stânga:** Date lunare cu  $s = 12$  (ciclu anual); **Dreapta:** Date trimestriale cu  $s = 4$
- Tiparul se repetă la fiecare  $s$  perioade  $\succ$  această regularitate este exploatată de SARIMA

## Exemple de date sezoniere

### Serii economice

- Vânzări cu amănuntul (vârfuri de sărbători)
- Turism (vara/iarna)
- Producție agricolă
- Consum de energie
- Ocuparea forței de muncă (cicluri de angajare)

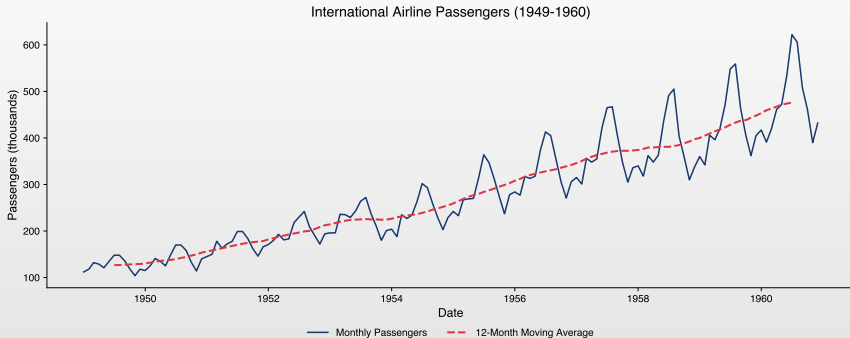
### Alte domenii

- Vreme/temperatură
- Trafic pe site-uri web
- Admisii la spital
- Utilizarea transportului
- Cererea de electricitate

### De ce contează

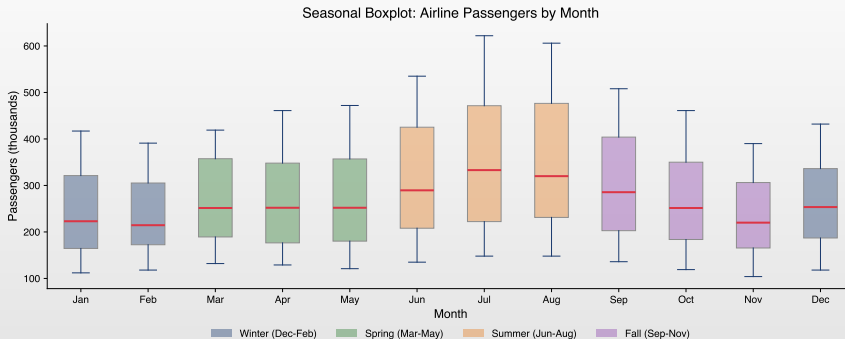
- Ignorarea sezonității duce la prognoze distorsionate și inferența invalidă!

## Exemplu: Datele privind pasagerii companiilor aeriene



- ▣ Pasageri internaționali lunari (1949–1960)
- ▣ **Trend ascendent** clar și **amplitudine sezonieră crescătoare**
- ▣ Vârfurile din vară reflectă tiparele călătoriilor de vacanță

## Vizualizarea tiparelor sezoniere



- Diagrama box plot relevă un tipar sezonier consistent
- Iulie–August: cele mai mari numere de pasageri (călătorii de vară)
- Noiembrie–Februarie: cele mai mici numere (lunile de iarnă)

## Sezonalitate deterministă vs stochastică

### Sezonalitate deterministă

- **Tipar sezonier fix:**  $Y_t = \sum_{j=1}^s \gamma_j D_{jt} + \varepsilon_t$ 
  - ▶  $D_{jt}$  sunt variabile dummy sezoniere
- **Tiparul** constant în timp
- **Eliminare:** prin regresie

### Sezonalitate stochastică

- **Tipar sezonier în evoluție:**  $\Delta_s Y_t = Y_t - Y_{t-s}$ 
  - ▶ Prezintă structura de dependență
- **Tiparul** evoluează în timp
- **Necesită** diferențiere sezonieră

## Detectarea sezonality

### Metode vizuale

- ▣ Graficul seriei de timp – căutați tipare repetitive
- ▣ Graficul sub-seriilor sezoniere – comparați aceleași sezoane de-a lungul anilor
- ▣ Graficul ACF – vârfuri la lag-uri sezoniere ( $s, 2s, 3s, \dots$ )

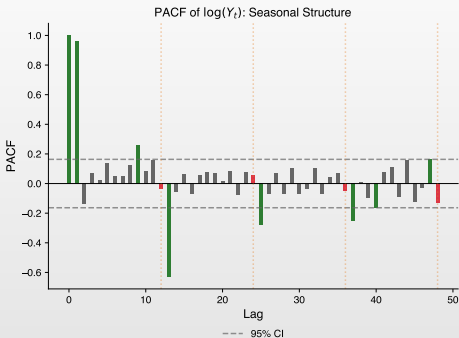
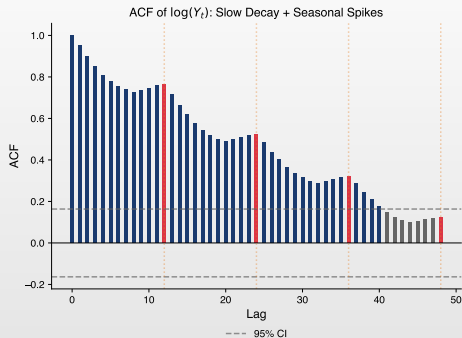
### Teste statistice

- ▣ Teste de rădăcină unitară sezonieră (HEGY, CH, OCSB)
- ▣ Testul F pentru variabile dummy sezoniere
- ▣ Testul Kruskal-Wallis (neparametric)

### Semnatura ACF

- ▣ Sezonalitate puternică: ACF prezintă vârfuri semnificative la lag-urile  $s, 2s, 3s, \dots$

## ACF relevă structura sezonieră



- ▣ Descreștere lentă la toate lag-urile indică nestaționaritate (trend)
- ▣ Vârfuri la lag-urile 12, 24, 36 confirmă tiparul sezonier ( $s = 12$ )
- ▣ ACF la lag-urile sezoniere: descreștere lentă  $\succ$  necesită diferențiere sezonieră



## Testul F pentru variabile dummy sezoniere: intuiție

### Ce face acest test?

- ▣ **Scop:** testează dacă valorile medii diferă semnificativ între sezoane
- ▣ **Logică:** dacă media din ianuarie  $\neq$  media din februarie  $\neq \dots \neq$  media din decembrie  $\succ$  sezonalitate
- ▣ **Metodă:** compară un model CU variabile dummy sezoniere vs. un model FĂRĂ

### Modelele comparate

- ▣ **Restricționat:**  $Y_t = \alpha + \varepsilon_t$     **Nerestricționat:**  $Y_t = \alpha + \sum_{j=1}^{s-1} \gamma_j D_{jt} + \varepsilon_t$
- ▣ unde  $D_{jt} = 1$  dacă observația  $t$  este în sezonul  $j$ , 0 altfel

### Ideea cheie

- ▣ Dacă adăugarea variabilelor dummy sezoniere **reduce semnificativ** erorile de predicție, atunci sezonalitatea este prezentă

## Testul F pentru variabile dummy sezoniere: formula și exemplu

### Formula statisticii F

- **Formula:**  $F = \frac{(SSR_R - SSR_U)/(s-1)}{SSR_U/(n-s)} \sim F_{s-1, n-s}$ 
  - ▶  $SSR_R$ : suma pătratelor reziduurilor din modelul restricționat (fără dummy)
  - ▶  $SSR_U$ : suma pătratelor reziduurilor din modelul nerestricționat (cu dummy)
  - ▶  $s - 1$ : numărul de restricții (lunar: 11, trimestrial: 3)

### Exemplu numeric (Date lunare, $n=120$ )

- $SSR_R = 15000$ ,  $SSR_U = 8500$ ,  $s = 12$
- $F = \frac{(15000-8500)/11}{8500/108} = \frac{590.9}{78.7} = 7.51$
- Valoarea critică  $F_{0.05, 11, 108} \approx 1.87$ . Deoarece  $7.51 > 1.87$ : **Respingem  $H_0$**  > Sezonalitate prezentă!

## Testul Kruskal-Wallis: intuiție

### Ce face acest test?

- ▣ **Test neparametric:** verifică dacă observațiile din diferite sezoane provin din aceeași distribuție
- ▣ **Mecanism:** ordonează toate observațiile de la cea mai mică la cea mai mare
- ▣ **Verificare:** dacă rangurile sunt distribuite uniform între sezoane
- ▣ **Concluzie:** dacă un sezon are constant ranguri mai mari/mici  $\succ$  sezonalitate

### De ce să-l folosim în locul testului F?

- ▣ **Fără ipoteza de normalitate** – funcționează cu orice distribuție
- ▣ **Robust la valori extreme** – valorile extreme nu distorsionează rezultatele

### Limitare

- ▣ Mai puțin puternic decât testul F când datele SUNT distribuite normal

## Testul Kruskal-Wallis: formula și exemplu

### Statistică de test

$$\square H = \frac{12}{N(N+1)} \sum_{j=1}^s \frac{R_j^2}{n_j} - 3(N+1) \quad \text{unde } N = \text{total obs.}, n_j = \text{obs. în sezonul } j, R_j = \text{suma rangurilor}$$

### Exemplu: Vânzări trimestriale (n=20, s=4)

- Date ordonate 1-20. Sumele rangurilor: T1:  $R_1 = 15$ , T2:  $R_2 = 35$ , T3:  $R_3 = 70$ , T4:  $R_4 = 90$
- $H = \frac{12}{20 \times 21} \left( \frac{15^2}{5} + \frac{35^2}{5} + \frac{70^2}{5} + \frac{90^2}{5} \right) - 3(21) = 19.6$
- Valoarea critică  $\chi_{0.05,3}^2 = 7.81$ . Deoarece  $19.6 > 7.81$ : **Respingem  $H_0$**  > Sezonalitate!

### În Python

- Implementare: `scipy.stats.kruskal(q1, q2, q3, q4)`

## Testul HEGY: ce problemă rezolvă?

### Întrebarea cheie

- ▣ **Problemă:** având o serie sezonieră, trebuie să știm tipul de diferențiere
- ▣ **Diferențiere obișnuită**  $(1 - L)^d$ ?  $\succ$  setăm  $d = 1$ ; **Diferențiere sezonieră**  $(1 - L^s)^D$ ?  $\succ$  setăm  $D = 1$
- ▣ **HEGY:** testează pentru ambele tipuri de rădăcini unitare simultan!

### De ce să nu folosim doar ADF?

- ▣ **ADF:** testează doar pentru o rădăcină unitară obișnuită la frecvența zero
- ▣ **Limitare:** datele sezoniere pot avea rădăcini unitare la frecvențe sezoniere pe care ADF le omite!

### HEGY testează frecvențe multiple

- ▣ **Trimestrial:** testează la  $0, \pi, \pm\pi/2$
- ▣ **Lunar:** testează la  $0, \pi, \pm\pi/6, \pm\pi/3, \pm\pi/2, \pm2\pi/3, \pm5\pi/6$

## Testul HEGY: Formula de regresie (Trimestrial)

### Regresia auxiliară HEGY

- **Date trimestriale** ( $s = 4$ ):  $\Delta_4 y_t = \pi_1 z_{1,t-1} + \pi_2 z_{2,t-1} + \pi_3 z_{3,t-2} + \pi_4 z_{4,t-2} + \sum_{j=1}^k \phi_j \Delta_4 y_{t-j} + \varepsilon_t$

### Variabile transformate

- $z_{1t}$ :  $(1 + L + L^2 + L^3)y_t = y_t + y_{t-1} + y_{t-2} + y_{t-3}$
- $z_{2t}$ :  $-(1 - L + L^2 - L^3)y_t = -y_t + y_{t-1} - y_{t-2} + y_{t-3}$
- $z_{3t}$ :  $-(1 - L^2)y_t = -y_t + y_{t-2}$
- $z_{4t}$ :  $-(L - L^3)y_t = -y_{t-1} + y_{t-3}$

### Ipoteze

- $H_0 : \pi_1 = 0$ : rădăcină unitară la frecvența 0
- $H_0 : \pi_2 = 0$ : rădăcină unitară la frecvența  $\pi$
- $H_0 : \pi_3 = \pi_4 = 0$ : rădăcină unitară la frecvența  $\pm\pi/2$

## Testul HEGY: Reguli de decizie cu exemple

### Valori critice HEGY (5%, $n=100$ , cu constanta)

Test	Statistică	Valoare critică	Dacă NU este respins...
$t_1$ ( $\pi_1 = 0$ )	t-stat	-2.88	Necesită $d = 1$
$t_2$ ( $\pi_2 = 0$ )	t-stat	-2.88	Necesită $D = 1$
$F_{34}$ ( $\pi_3 = \pi_4 = 0$ )	F-stat	6.57	Necesită $D = 1$

### Exemplu: PIB trimestrial

- ▣ **Rezultate HEGY:**  $t_1 = -1.52$ ,  $t_2 = -4.21$ ,  $F_{34} = 2.15$
- ▣  $t_1 = -1.52 > -2.88$ : Nu putem respinge  $\succ$  **necesită**  $d = 1$
- ▣  $t_2 = -4.21 < -2.88$ : Respingem  $\succ$  fără rădăcină unitară la  $\pi$
- ▣  $F_{34} = 2.15 < 6.57$ : Nu putem respinge  $\succ$  **necesită**  $D = 1$
- ▣ **Concluzie:** Folosim SARIMA cu  $d = 1$ ,  $D = 1$

## Testul Canova-Hansen: opusul testului HEGY

### HEGY vs Canova-Hansen: Ipoteze nule diferite!

	HEGY	Canova-Hansen
$H_0$	Rădăcină unitară sezonieră	<b>Fără</b> rădăcină unitară sezonieră
$H_1$	Fără rădăcină unitară sezonieră	Rădăcină unitară sezonieră
Respingem $H_0$	Folosim variabile dummy sezoniere	Folosim diferențiere ( $1 - L^s$ )
Nu respingem	Folosim diferențiere ( $1 - L^s$ )	Folosim variabile dummy sezoniere

### De ce contează?

- HEGY: “Demonstrați că NU există rădăcină unitară” (conservator față de diferențiere)
- CH: “Demonstrați că EXISTĂ rădăcină unitară” (conservator față de variabile dummy)
- Folosiți **ambele** teste pentru concluzii robuste!



## Testul Canova-Hansen: formula

### Procedura de testare

- ▢ **Pas 1:** Regresam  $y_t$  pe variabile dummy sezoniere:  $y_t = \sum_{j=1}^s \gamma_j D_{jt} + u_t$
- ▢ **Pas 2:** Calculam sumele parțiale la frecvența sezonieră  $\lambda_i$ :
  - ▶  $S_{it}^{(c)} = \sum_{j=1}^t \hat{u}_j \cos(\lambda_i j)$ ,  $S_{it}^{(s)} = \sum_{j=1}^t \hat{u}_j \sin(\lambda_i j)$

### Statistică de test LM

- ▢  $LM_i = \frac{1}{T^2 \hat{\omega}_i} \left[ \sum_{t=1}^T (S_{it}^{(c)})^2 + \sum_{t=1}^T (S_{it}^{(s)})^2 \right]$
- ▢ unde  $\hat{\omega}_i$  = estimator consistent al densității spectrale la frecvența  $\lambda_i$

### Decizie

- ▢ **Regula:** respingem  $H_0$  (staționaritate) dacă  $LM >$  valoare critică  $\succ$  este necesară diferențierea sezonieră

## Sumar: Alegerea testului de sezonalitate potrivit

Test	$H_0$	Dacă respingem	Cel mai bun pentru
Test F Kruskal-Wallis	Fără sezonalitate Fără diferență între sezoane	Sezonalitate există Sezonalitate există	Date normale Non-normale, valori ex- treme
HEGY	Rădăcină unitară ex- istă	Folosim dummy	Determinarea $d$ , $D$
Canova-Hansen	Fără rădăcină unitară	Folosim $(1 - L^s)$	Confirmarea stabilității

### Ideea cheie

- Test F/Kruskal-Wallis: “Există sezonalitate?”
- HEGY/Canova-Hansen: “Ce tip?” (deterministă vs stochastică)

## Operatorul de diferență sezonieră

### Definiție 2 (Diferență sezonieră)

- Operatorul de diferență sezonieră  $\Delta_s$  este definit ca:

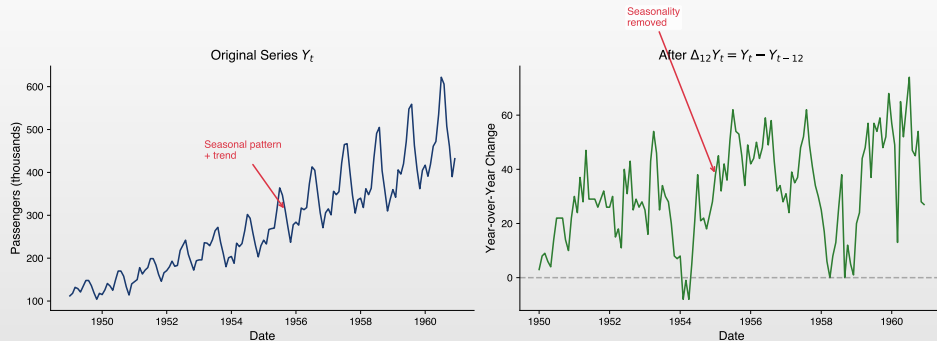
$$\Delta_s Y_t = (1 - L^s) Y_t = Y_t - Y_{t-s}$$

- unde  $L^s Y_t = Y_{t-s}$  este operatorul de lag sezonier

### Exemple

- Date lunare** ( $s = 12$ ):  $\Delta_{12} Y_t = Y_t - Y_{t-12}$ 
  - ▶ Compară fiecare lună cu aceeași lună din anul trecut
- Date trimestriale** ( $s = 4$ ):  $\Delta_4 Y_t = Y_t - Y_{t-4}$ 
  - ▶ Compară fiecare trimestru cu același trimestru din anul trecut

## Diferența sezonieră: Ilustrare vizuală



- **Stânga:** Seria originală cu tipar sezonier clar
- **Dreapta:** După  $\Delta_{12} = (1 - L^{12})$ , tiparul sezonier este eliminat
  - Comparația an-la-an elimină efectele sezoniere

## Demonstrație: diferențierea sezonieră elimină sezonalitatea deterministă

### Afirmație

- Dacă  $Y_t = \mu_t + \varepsilon_t$  unde  $\mu_t = \mu_{t-s}$  (medie periodică), atunci  $\Delta_s Y_t$  elimină media sezonieră

### Demonstrație

- Fie  $Y_t = \mu_t + \varepsilon_t$  unde  $\mu_t$  are perioadă  $s$ . Aplicăm diferența sezonieră:  

$$\Delta_s Y_t = (\mu_t + \varepsilon_t) - (\mu_{t-s} + \varepsilon_{t-s}) = 0 + \varepsilon_t - \varepsilon_{t-s} \quad (\text{deoarece } \mu_t = \mu_{t-s})$$

### Proprietățile lui $\Delta_s Y_t = \varepsilon_t - \varepsilon_{t-s}$

- $\mathbb{E}[\Delta_s Y_t] = 0$  (medie constantă);  $\text{Var}(\Delta_s Y_t) = 2\sigma^2$  (varianță constantă)
- **Autocovarianța:**  $\gamma(s) = -\sigma^2$ ,  $\gamma(k) = 0$  pentru  $k \neq 0, s$

### Rezultat

- **Concluzie:** diferențierea sezonieră transformă tiparul sezonier periodic în MA(1) la lag-ul sezonier

## Combinarea diferențierii obișnuite și sezoniere

### Diferențiere completă

- ▣ **Serii cu trend și sezonalitate:**  $\Delta\Delta_s Y_t = (1 - L)(1 - L^s)Y_t$

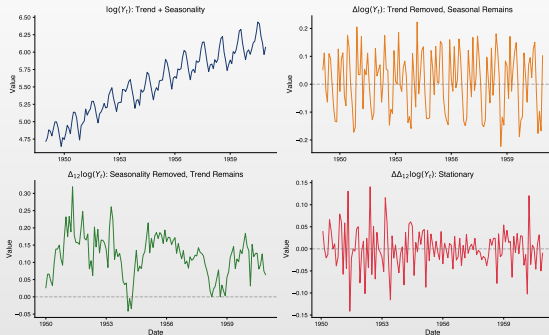
### Dezvoltare

- ▣ **General:**  $(1 - L)(1 - L^s)Y_t = Y_t - Y_{t-1} - Y_{t-s} + Y_{t-s-1}$
- ▣ **Date lunare** ( $s = 12$ ):  $\Delta\Delta_{12} Y_t = Y_t - Y_{t-1} - Y_{t-12} + Y_{t-13}$

### Ordinea diferențierii

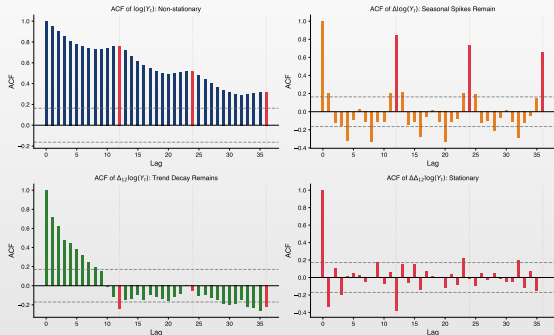
- ▣  $d$ : numărul de diferențe obișnuite (eliminarea trendului)
- ▣  $D$ : numărul de diferențe sezoniere (eliminarea trendului sezonier)

## Efectul operațiilor de diferențiere



- Diferențierea obișnuită elimină trendul dar tiparul sezonier rămâne
- Diferențierea sezonieră elimină sezonalitatea dar tiparul de trend rămâne
- **Ambele diferențe** sunt necesare pentru a atinge staționaritatea

## ACF înainte și după diferențiere



- ACF originală: descreștere lentă indică nestăționaritate
- După  $\Delta$ : vârfuri sezoniere rămân la lag-urile 12, 24, 36
- După  $\Delta_{12}$ : descreșterea de trend rămâne la lag-urile inițiale
- După  $\Delta \Delta_{12}$ : ACF se oprește brusc ➤ **staționară**



## Integrare sezonieră

### Definiție 3 (Proces integrat sezonier)

- O serie  $Y_t$  este **integrată sezonier** de ordinul  $(d, D)_s$ , scrisă  $Y_t \sim I(d, D)_s$ , dacă:

$$(1 - L)^d (1 - L^s)^D Y_t$$

- este staționară

### Cazuri comune

- $I(1, 0)_{12}$ : Doar rădăcină unitară obișnuită (lunară)
- $I(0, 1)_{12}$ : Doar rădăcină unitară sezonieră
- $I(1, 1)_{12}$ : Atât rădăcină unitară obișnuită cât și sezonieră

## Definiția modelului SARIMA

### Definiție 4 ( $\text{SARIMA}(p, d, q) \times (P, D, Q)_s$ )

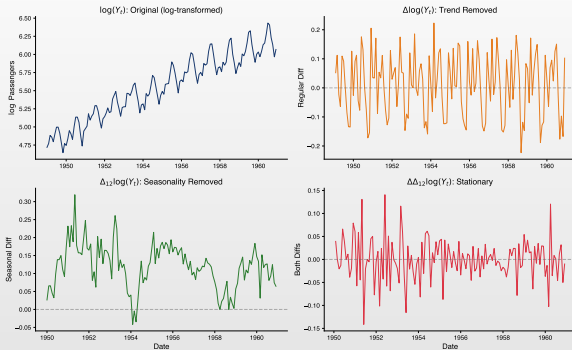
▣ Modelul **Seasonal ARIMA** este:

$$\phi(L)\Phi(L^s)(1-L)^d(1-L^s)^DY_t = c + \theta(L)\Theta(L^s)\varepsilon_t$$

### Componente

- ▣  $\phi(L) = 1 - \phi_1 L - \dots - \phi_p L^p$ : AR non-sezonier
- ▣  $\Phi(L^s) = 1 - \Phi_1 L^s - \dots - \Phi_P L^{Ps}$ : AR sezonier
- ▣  $\theta(L) = 1 + \theta_1 L + \dots + \theta_q L^q$ : MA non-sezonier
- ▣  $\Theta(L^s) = 1 + \Theta_1 L^s + \dots + \Theta_Q L^{Qs}$ : MA sezonier
- ▣  $(1-L)^d$ : Diferențiere obișnuită;  $(1-L^s)^D$ : Diferențiere sezonieră

## SARIMA: Ilustrare vizuală



- Originală  $\succ$  diferență obișnuită (elimină trendul)  $\succ$  diferență sezonieră (elimină sezonalitatea)
- Aplicați diferențierea minimă necesară pentru staționaritate

## Demonstrație: structura multiplicativă sezonieră

### De ce multiplicativă?

- Considerăm  $\text{SARIMA}(1, 0, 0) \times (1, 0, 0)_s$ :  $(1 - \phi L)(1 - \Phi L^s)Y_t = \varepsilon_t$

### Dezvoltăm produsul

- $(1 - \phi L)(1 - \Phi L^s)Y_t = Y_t - \phi Y_{t-1} - \Phi Y_{t-s} + \phi\Phi Y_{t-s-1}$
- Rezultat:** modelul include un **termen de interacțiune**  $\phi\Phi Y_{t-s-1}$

### Interpretare (Lunar, $s = 12$ )

- $Y_{t-1}$ : luna trecută;  $Y_{t-12}$ : aceeași lună anul trecut;  $Y_{t-13}$ : interacțiunea ambelor

### Parcimonie

- Multiplicativă:** 2 parametri  $(\phi, \Phi)$ ; **Aditivă:** ar necesita 3+ parametri

## Notația SARIMA

### Specificație completă

- ▣ **SARIMA**( $p, d, q$ )  $\times$  ( $P, D, Q$ ) <sub>$s$</sub> : are 7 parametri de specificat

### Cei 7 parametri

Parametru	Semnificație
$p, d, q$	Ordine AR, diferențiere, MA non-sezoniere
$P, D, Q$	Ordine AR, diferențiere, MA sezoniere
$s$	Perioada sezonieră

### Exemplu

- ▣ **SARIMA**(1, 1, 1)  $\times$  (1, 1, 1)<sub>12</sub>: date lunare cu AR(1), MA(1), AR sezonier(1), MA sezonier(1), și atât diferențiere obișnuită cât și sezonieră

## Modele SARIMA comune

Modelul Airline:  $\text{SARIMA}(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_s$

- **Ecuția:**  $(1 - L)(1 - L^s)Y_t = (1 + \theta L)(1 + \Theta L^s)\varepsilon_t$
- **Origine:** model clasic (Box & Jenkins, 1970)

$\text{SARIMA}(1, 0, 0) \times (1, 0, 0)_s$

- **Ecuția:**  $(1 - \phi L)(1 - \Phi L^s)Y_t = \varepsilon_t$
- **Descriere:** AR sezonier și non-sezonier pur

$\text{SARIMA}(0, 1, 1) \times (0, 1, 0)_s$

- **Ecuția:**  $(1 - L)(1 - L^s)Y_t = (1 + \theta L)\varepsilon_t$
- **Descriere:** random walk + dif. sezonieră + MA(1)

## Structura multiplicativă

### De ce multiplicativă?

- ▣ **Principiu:** părțile sezonieră și non-sezonieră se înmulțesc
- ▣ **AR:**  $\phi(L)\Phi(L^s)$     **MA:**  $\theta(L)\Theta(L^s)$

### Exemplu: $\text{SARIMA}(1, 0, 0) \times (1, 0, 0)_{12}$

- ▣ **Model:**  $(1 - \phi L)(1 - \Phi L^{12})Y_t = \varepsilon_t$
- ▣ **Dezvoltare:**  $Y_t - \phi Y_{t-1} - \Phi Y_{t-12} + \phi\Phi Y_{t-13} = \varepsilon_t$
- ▣ **Termenul încrucișat**  $\phi\Phi Y_{t-13}$  captează interacțiunea!

### Interpretare

- ▣ **Avantaj:** structura multiplicativă permite modelarea parcimonioasă a tiparelor sezoniere complexe cu puțini parametri

## ACF/PACF pentru modele sezoniere

### Ideea cheie

- ▣ **Modelele sezoniere:** prezintă tipare la ambele tipuri de lag-uri
- ▣ **Lag-uri non-sezoniere:**  $1, 2, 3, \dots$
- ▣ **Lag-uri sezoniere:**  $s, 2s, 3s, \dots$

### Tipare ACF/PACF sezoniere

Model	ACF	PACF
SAR( $P$ )	Scade la $s, 2s, \dots$	Se oprește după $P_s$
SMA( $Q$ )	Se oprește după $Q_s$	Scade la $s, 2s, \dots$
SARMA	Scade la lag-uri sezoniere	Scade la lag-uri sezoniere



## Exemplu: ACF/PACF pentru modelul Airline

**SARIMA(0, 1, 1)  $\times$  (0, 1, 1)<sub>12</sub>**

- ▣ **Diferențiere:**  $W_t = (1 - L)(1 - L^{12})Y_t$
- ▣ **Model:**  $W_t = (1 + \theta L)(1 + \Theta L^{12})\varepsilon_t$

### Tiparul ACF așteptat

- ▣ Vârf la lag-ul 1 (de la  $\theta$ )
- ▣ Vârf la lag-ul 12 (de la  $\Theta$ )
- ▣ Vârf la lag-ul 13 (de la interacțiunea  $\theta \cdot \Theta$ )
- ▣ Toate celelalte lag-uri aproape de zero

### Tiparul PACF așteptat

- ▣ Descreștere exponențială la lag-urile 1, 2, 3, ...
- ▣ Descreștere exponențială la lag-urile 12, 24, 36, ...

## Ghid de identificare a modelului

### Proces pas cu pas

- ▣ **Pas 1:** examinați ACF pentru descreștere lentă la lag-uri sezoniere  $\succ$  diferențiere sezonieră
- ▣ **Pas 2:** după diferențiere, verificați tiparele ACF/PACF
- ▣ **Pas 3:** comportamentul non-sezonier la lag-urile  $1, 2, \dots, s - 1$
- ▣ **Pas 4:** comportamentul sezonier la lag-urile  $s, 2s, 3s, \dots$

### Sfaturi practice

- ▣ Începeți cu  $d \leq 1$  și  $D \leq 1$
- ▣ De obicei  $P, Q \leq 2$  este suficient
- ▣ Folosiți criterii informaționale (AIC, BIC) pentru selecția finală
- ▣ Algoritmii Auto-SARIMA pot ajuta

## Metode de estimare

### Estimare prin verosimilitate maximă

- ▣ **Abordare standard** pentru SARIMA:
  - ▶ MLE condiționată (condiționată de valorile inițiale)
  - ▶ MLE exactă (prin filtrul Kalman)

### Considerații computaționale

- ▣ Mai mulți parametri decât ARIMA  $\succ$  mai multe date necesare
- ▣ Parametrii sezonieri estimați din lag-urile  $s, 2s, \dots$
- ▣ Necesită suficiente cicluri sezoniere (cel puțin 3-4 ani de date lunare)

## Verosimilitate exactă: descompunerea erorilor de predicție

### De ce filtrul Kalman?

- ▣ **SARIMA**: are structura unui model state-space
- ▣ **Filtrul Kalman**: calculează recursiv erorile de predicție  $v_t$  și varianțele lor  $f_t$ , fără a condiționa pe valori inițiale

### Log-verosimilitatea exactă (prediction error decomposition)

- ▣ **Formula**:  $\ell(\theta) = -\frac{T}{2} \ln(2\pi) - \frac{1}{2} \sum_{t=1}^T \left[ \ln(f_t) + \frac{v_t^2}{f_t} \right]$
- ▣  $v_t$ :  $Y_t - \hat{Y}_{t|t-1}$  (inovația);  $f_t$ :  $\text{Var}(v_t)$  (varianța inovației)

### Avantaje față de MLE condiționată

- ▣ Nu necesită alegerea valorilor inițiale
- ▣ Fiecare termen  $\ln(f_t)$  ponderează diferit observațiile (varianță variabilă la început)
- ▣ Esențial pentru serii scurte unde valorile inițiale contează
- ▣ Implementat implicit în `statsmodels.tsa.SARIMAX()` cu `method='mle'`

## Staționaritate și invertibilitate

### Condiții de staționaritate

- ▣ **Cerință:** polinoamele AR trebuie să aibă rădăcini în afara cercului unitate
- ▣ **Non-sezonier:**  $\phi(z) = 0 \wedge |z| > 1$
- ▣ **Sezonier:**  $\Phi(z^s) = 0 \wedge |z| > 1$

### Condiții de invertibilitate

- ▣ **Cerință:** polinoamele MA trebuie să aibă rădăcini în afara cercului unitate
- ▣ **Non-sezonier:**  $\theta(z) = 0 \wedge |z| > 1$
- ▣ **Sezonier:**  $\Theta(z^s) = 0 \wedge |z| > 1$

## Validarea modelului

### Analiza reziduurilor

- ▣ **Scop:** verificați că reziduurile sunt zgomot alb
- ▣ **Graficul reziduurilor:** în timp (fără tipare)
- ▣ **ACF:** a reziduurilor (fără vârfuri semnificative)
- ▣ **Ljung-Box:** la lag-uri multiple inclusiv sezoniere
- ▣ **Normalitate:** grafic Q-Q, testul Jarque-Bera

### Important

- ▣ **Verificați ACF** la ambele lag-uri non-sezoniere și sezoniere!
- ▣ **ACF semnificativă** la lag-ul 12 sugerează modelare sezonieră inadecvată

## Criterii de selecție a modelului

### Criterii informaționale

- ▣ **AIC:**  $-2 \ln(L) + 2k$
- ▣ **BIC:**  $-2 \ln(L) + k \ln(n)$
- ▣ **AICc:**  $AIC + \frac{2k(k+1)}{n-k-1}$  (corectat pentru eșantioane mici)
- ▣ **Parametri:**  $k = p + q + P + Q + 1$  (plus 1 pentru varianță)

unde:  $L$  = maximul funcției de verosimilitate,  $k$  = nr. parametri,  $n$  = dimensiunea eșantionului

### Auto-SARIMA

- ▣ **Python:** `pmdarima.auto_arima()` cu `seasonal=True`
- ▣ **Funcție:** caută automat  $(p, d, q) \times (P, D, Q)_s$  optim

## Proгноze punctuale

### Calculul prognozei

- ▣ **Metoda:** prognozele SARIMA sunt calculate recursiv
- ▣ **Erori viitoare:** înlocuiți  $\varepsilon_{T+h}$  cu 0
- ▣ **Valori viitoare:** înlocuiți  $Y_{T+h}$  cu prognozele  $\hat{Y}_{T+h|T}$
- ▣ **Valori trecute:** folosiți  $Y_T, Y_{T-1}, \dots$  cunoscute

### Tiparul sezonier în prognoze

- ▣ **Proprietate:** prognozele SARIMA captează în mod natural sezonabilitatea
- ▣ **Pe termen scurt:** influențate de valorile recente
- ▣ **Pe termen lung:** revin la tiparul sezonier



## Intervale de prognoză

### Cuantificarea incertitudinii

- Interval  $(1 - \alpha)\%$ :  $\hat{Y}_{T+h|T} \pm z_{\alpha/2} \sqrt{\text{Var}(e_{T+h})}$
- Varianța: calculată din reprezentarea  $MA(\infty)$

### Proprietăți cheie

- Intervalele se lărgesc cu orizontul de prognoză
- Pentru serii  $I(1, 1)_s$ : intervalele cresc nelimitat
- Tiparul sezonier vizibil în prognozele punctuale
- Incetitudinea captează atât variația de trend cât și cea sezonieră

## Proгноze pe orizont lung

### Comportamentul când $h \rightarrow \infty$

- ▣ Proгноzele punctuale converg la tiparul sezonier determinist
- ▣ Dacă există derivă: trend linear + tipar sezonier
- ▣ Intervalele de prognoză continuă să se lărgască

### Implicație practică

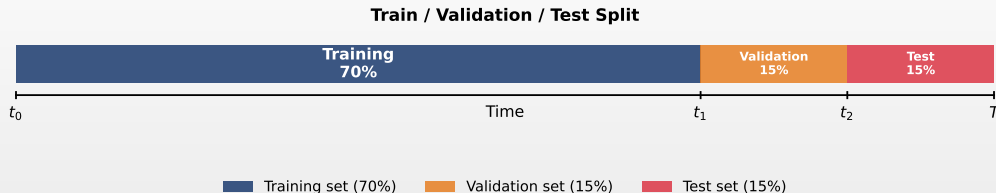
- ▣ Pe termen scurt: SARIMA captează atât dinamica pe termen scurt cât și sezonul
- ▣ Pe termen mediu: Proгноze sezoniere bune, incertitudine crescătoare
- ▣ Pe termen lung: Reflectă în principal tiparul sezonier, intervale largi

## Studiu de caz: Date despre pasagerii aerieni



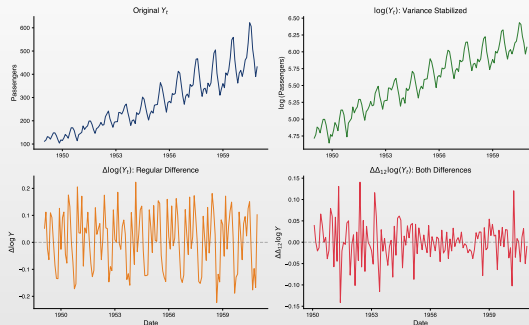
- Setul de date clasic Box-Jenkins: număr de pasageri lunari (1949-1960)
- Trend ascendent clar și amplitudine sezonieră crescătoare
- Sezonalitatea multiplicativă sugerează transformarea logaritmică

## Strategia de împărțire a datelor



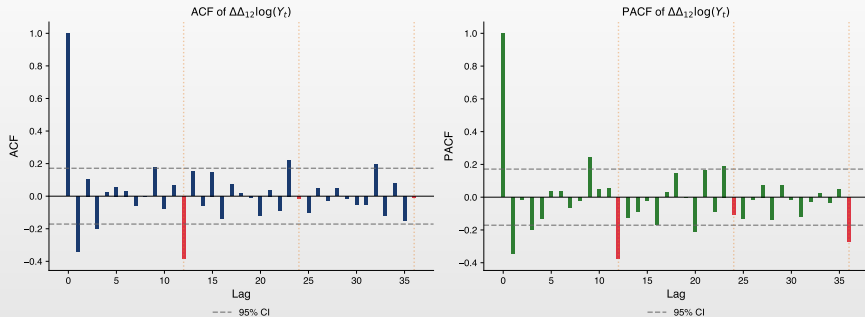
- ▣ **Set de antrenare (70%)** — Estimarea parametrilor modelului
  - ▶ Estimare coeficienți SARIMA ( $\phi, \theta, \Phi, \Theta$ )
  - ▶ Porțiunea cea mai mare asigură estimări fiabile ale parametrilor
- ▣ **Set de validare (15%)** — Selectarea celui mai bun model
  - ▶ Comparare modele candidate (ordine diferite)
  - ▶ Alegere model cu cea mai mică eroare de validare
- ▣ **Set de test (15%)** — Evaluare finală
  - ▶ Performanță out-of-sample imparțială; niciodată folosit în dezvoltare

## Pasul 1: Transformări



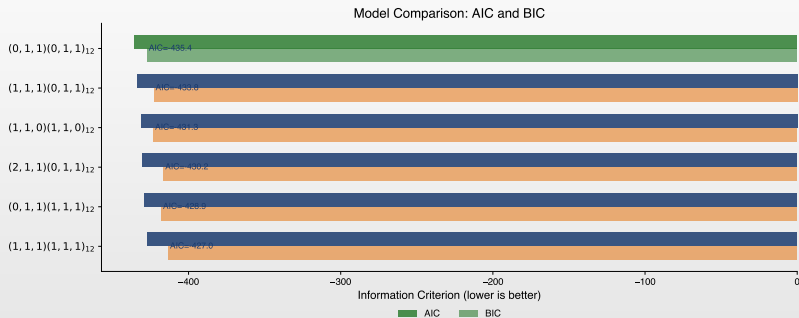
- Transformarea log stabilizează varianța (multiplicativ  $\succ$  aditiv)
- Prima diferență elimină trendul; diferența sezonieră elimină sezonalitatea
- Seria dublu diferențiată pare staționară

## Pasul 2: Analiza ACF/PACF



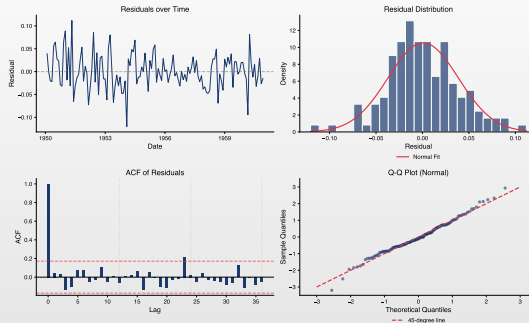
- ACF: Vârf semnificativ la lag 1 și lag 12  $\succ$  MA(1), SMA(1)
- PACF: Tipar de descreștere exponențială confirmă structura MA
- Sugerează SARIMA(0, 1, 1)  $\times$  (0, 1, 1)<sub>12</sub> (modelul airline)

## Pasul 3: Compararea modelelor



- Comparăm modelele SARIMA candidate folosind criteriul AIC
- $\text{SARIMA}(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_{12}$  oferă cea mai bună ajustare (AIC minim)
- Acesta este faimosul “model airline” identificat de Box & Jenkins

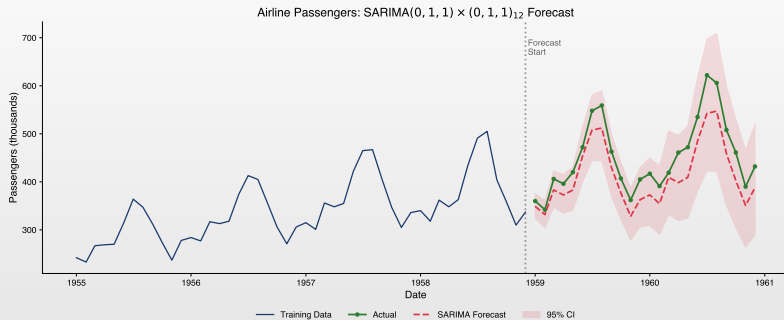
## Pasul 4: Diagnosticul reziduurilor



- Reziduurile par aleatorii fără autocorelație remanentă
- Graficul Q-Q arată normalitate aproximativă
- Modelul captează adecvat atât trendul cât și structura sezonieră



## Pasul 5: Prognoza



- Prognoză pe 24 de luni cu interval de încredere de 95%
- Modelul captează tiparul sezonier și trendul ascendent
- Intervalele de predicție se lărgesc corespunzător cu orizontul prognozei

## Concluzii cheie

### Puncte principale

- **Sezonalitatea:** este comună în datele economice și de afaceri
- **Diferențierea sezonieră:**  $(1 - L^s)$  elimină sezonalitatea stochastică
- **SARIMA:**  $(p, d, q) \times (P, D, Q)_s$  extinde ARIMA pentru date sezoniere
- **Structura multiplicativă:** captează interacțiunile sezon-trend
- **ACF/PACF:** prezintă tipare la ambele lag-uri obișnuite și sezoniere
- **Selecția modelului:** folosiți AIC/BIC sau algoritmi auto-SARIMA

### Pașii următori

- **Capitolul 5:** va acoperi modelarea volatilității  $\succ$  modele ARCH, GARCH și extensii asimetrice

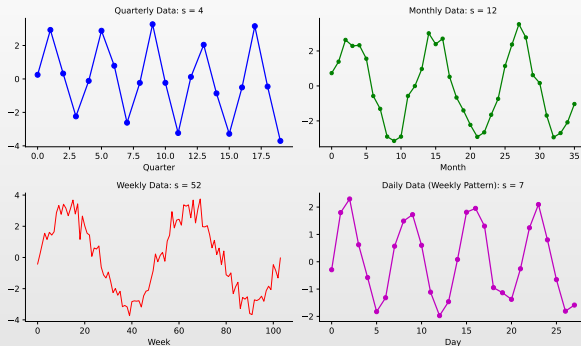
## Întrebarea 1

### Întrebare

☐ Pentru date lunare cu sezonalitate anuală, care este perioada sezonieră  $s$ ?

- (A)  $s = 4$
- (B)  $s = 7$
- (C)  $s = 12$
- (D)  $s = 52$

## Întrebarea 1: Răspuns



Răspuns corect: (C)  $s = 12$  (12 luni pe an)

▣ **Perioade comune:** Trimestrial=4, Lunar=12, Săptămânal=52, Zilnic=7, Orar=24

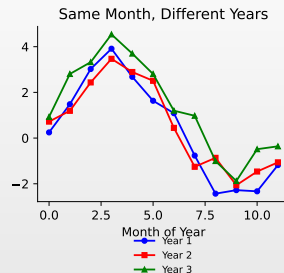
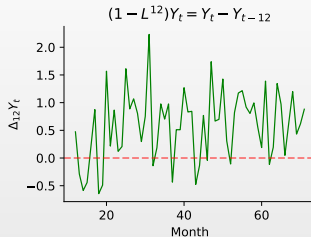
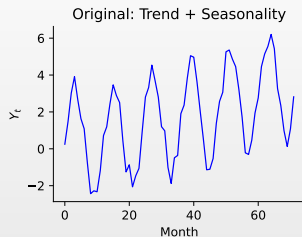
## Întrebarea 2

### Întrebare

☐ Ce face operatorul de diferență sezonieră  $(1 - L^{12})$  unei serii lunare?

- (A) Calculează  $Y_t - Y_{t-1}$  (schimbarea luna-la-luna)
- (B) Calculează  $Y_t - Y_{t-12}$  (schimbarea an-la-an)
- (C) Calculează media mobilă pe 12 luni
- (D) Elimină doar componenta de trend

## Întrebarea 2: Răspuns



Răspuns corect: (B) Schimbarea an-la-an

- ☐ **Formula:**  $(1 - L^{12})Y_t = Y_t - Y_{t-12}$
- ☐ **Efect:** elimină tiparul sezonier prin compararea acelorași luni

### Întrebarea 3

#### Întrebare

□ În notația  $\text{SARIMA}(1, 1, 1) \times (1, 1, 1)_{12}$ , ce reprezintă partea  $(1, 1, 1)_{12}$ ?

- (A) AR(1), o diferențiere, MA(1) pentru componenta non-sezonieră
- (B) AR sezonier(1), o diferențiere sezonieră, MA sezonier(1)
- (C) 12 termeni AR, 12 diferențe, 12 termeni MA
- (D) Modelul are 12 parametri în total

### Întrebarea 3: Răspuns

Răspuns corect: (B)

- ▣ **Răspuns:** AR sezonier(1), o diferențiere sezonieră, MA sezonier(1)

#### Descompunerea notației SARIMA

- ▣  $(p, d, q)$ : Non-sezonier  $\succ$  AR( $p$ ),  $d$  diferențe, MA( $q$ )
- ▣  $(P, D, Q)_s$ : Sezonier  $\succ$  SAR( $P$ ),  $D$  dif. sezoniere, SMA( $Q$ )
- ▣ **Non-sezonier** (1, 1, 1): AR(1), o diferență obișnuită, MA(1)
- ▣ **Sezonier** (1, 1, 1)<sub>12</sub>: SAR(1) la lag-ul 12, un  $\Delta_{12}$ , SMA(1) la lag-ul 12



## Întrebarea 4

### Întrebare

□ “Modelul Airline” este  $SARIMA(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_{12}$ . Câți parametri trebuie estimați (excluzând varianța)?

- (A) 1
- (B) 2
- (C) 4
- (D) 12

## Întrebarea 4: Răspuns

Răspuns corect: (B)

- ▣ **Răspuns:** 2 parametri

### Structura modelului

- ▣ **Model:**  $(1 - L)(1 - L^{12})Y_t = (1 + \theta_1 L)(1 + \Theta_1 L^{12})\varepsilon_t$
- ▣  $\theta_1$ : coeficient MA non-sezonier
- ▣  $\Theta_1$ : coeficient MA sezonier
- ▣ **Total:** 2 parametri (plus  $\sigma^2$ )

### De ce “Modelul Airline”?

- ▣ **Origine:** Box & Jenkins (1970) au folosit acest model pentru a prognoza pasagerii companiilor aeriene internaționale
- ▣ **Impact:** remarcabil de eficient pentru multe serii economice sezoniere!

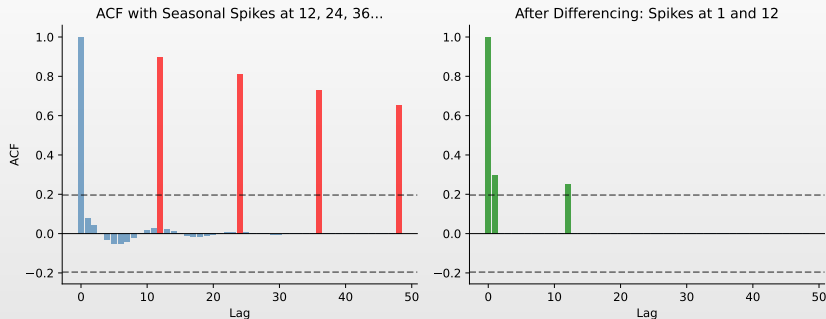
## Întrebarea 5

### Întrebare

☐ Observați vârfuri ACF semnificative la lag-urile 12, 24 și 36 într-o serie lunară. Ce sugerează aceasta?

- (A) Seria are o rădăcină unitară
- (B) Seria are sezonalitate anuală care necesită diferențiere sezonieră
- (C) Seria urmează un proces AR(36)
- (D) Seria este deja staționară

## Întrebarea 5: Răspuns



Răspuns corect: (B) Necesită diferențiere sezonieră

- ☐ **Diagnostic:** vârfuri ACF la 12, 24, 36 = sezonabilitate stohastică
- ☐ **Soluție:** aplicați  $(1 - L^{12})$  pentru a o elimina

## Întrebarea 6

### Întrebare

- ☐ După aplicarea  $(1 - L)(1 - L^{12})$  unei serii lunare, ACF prezintă un vârf semnificativ doar la lag-ul 1 și lag-ul 12. Ce model SARIMA este sugerat?

- (A)  $\text{SARIMA}(1, 1, 0) \times (1, 1, 0)_{12}$
- (B)  $\text{SARIMA}(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_{12}$
- (C)  $\text{SARIMA}(1, 1, 1) \times (1, 1, 1)_{12}$
- (D)  $\text{SARIMA}(0, 1, 0) \times (0, 1, 0)_{12}$

## Întrebarea 6: Răspuns

Răspuns corect: (B)

- ▣ **Model:**  $\text{SARIMA}(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_{12}$  (Modelul Airline)

### Reguli de identificare ACF/PACF

- ▣ **Regulă:** pentru procese MA, ACF se oprește brusc după lag-ul  $q$
- ▣ **Vârf ACF la lag-ul 1:** MA(1) pentru partea non-sezonieră
- ▣ **Vârf ACF la lag-ul 12:** SMA(1) pentru partea sezonieră
- ▣ **Combinat:**  $\text{MA}(1) \times \text{SMA}(1) = (0, d, 1) \times (0, D, 1)_{12}$
- ▣ **Cu  $d = 1, D = 1$ :**  $(0, 1, 1) \times (0, 1, 1)_{12}$

## Bibliografie I

### Modele sezoniere > lucrări fundamentale

- Box, G.E.P., Jenkins, G.M., Reinsel, G.C., & Ljung, G.M. (2015). *Time Series Analysis: Forecasting and Control*, 5th ed., Wiley.
- Hyllberg, S., Engle, R.F., Granger, C.W.J., & Yoo, B.S. (1990). Seasonal Integration and Cointegration, *Journal of Econometrics*, 44(1-2), 215–238.
- Canova, F., & Hansen, B.E. (1995). Are Seasonal Patterns Constant Over Time?, *Journal of Business & Economic Statistics*, 13(3), 237–252.

### Descompunere sezonieră și diagnoză

- Cleveland, R.B., Cleveland, W.S., McRae, J.E., & Terpenning, I. (1990). STL: A Seasonal-Trend Decomposition Procedure Based on Loess, *Journal of Official Statistics*, 6(1), 3–33.
- Hyndman, R.J., & Athanasopoulos, G. (2021). *Forecasting: Principles and Practice*, 3rd ed., OTexts.

## Bibliografie II

### Manuale și referințe suplimentare

- ▣ Shumway, R.H., & Stoffer, D.S. (2017). *Time Series Analysis and Its Applications*, 4th ed., Springer.
- ▣ Brockwell, P.J., & Davis, R.A. (2016). *Introduction to Time Series and Forecasting*, 3rd ed., Springer.
- ▣ Hyndman, R.J., & Khandakar, Y. (2008). Automatic Time Series Forecasting: The forecast Package for R, *Journal of Statistical Software*, 27(3), 1–22.

### Resurse online și cod

- ▣ **Quantlet:** <https://quantlet.com> > Platformă de cod pentru statistică
- ▣ **Quantinar:** <https://quantinar.com> > Platformă de învățare metode cantitative
- ▣ **GitHub TSA:** [https://github.com/QuantLet/TSA/tree/main/TSA\\_ch4](https://github.com/QuantLet/TSA/tree/main/TSA_ch4) > Cod Python pentru acest curs



# Vă Mulțumim!

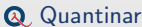
## Întrebări?

*Graficele au fost generate folosind Python (statsmodels, matplotlib)*

Materialele cursului sunt disponibile la: <https://danpele.github.io/Time-Series-Analysis/>



Quantlet



Quantinar