

这组数据是求滞后数为2的自相关系数,则变成求{x1,x2,...,x8}和{x3,x4,...,x10}两者的"相关系数",相关系数打引号是因为这个相关系数往的有点不一样。下面看一下公式的对比:

$$\sum_{i=1}^{n-h} \frac{(x_i - \hat{\mu}) (x_{i+h} - \hat{\mu})}{\sum_{i=1}^{n} (x_i - \hat{\mu})^2} - \dots - \text{自相关系数}$$

$$\sum_{i=1}^{n} \frac{(x_i - \hat{\mu}_1) (y_i - \hat{\mu}_2)}{\sum_{i=1}^{n} \left(\sqrt{(x_i - \hat{\mu}_1)^2 (y_i - \hat{\mu}_2)^2}\right)_{\text{ttp://blog.csdn.net/WMN7Q}}$$

在mathematica中,求自相关系数的函数为 CorrelationFunction[]

偏自相关系数

偏自相关系数在网上能查到的很少,我就详细的讲一下。

首先是定义:

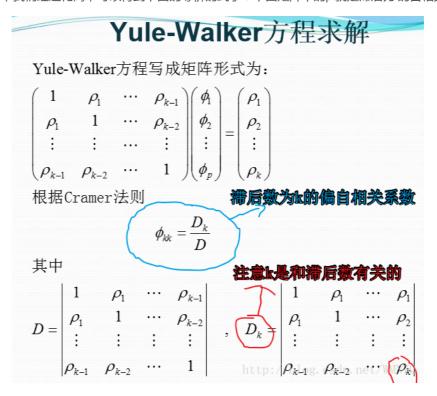
❖ 定义 偏自相关系数的定义

对于平稳 AR(p)序列,所谓滞后k偏自相关系数就是指在给定中间k-1个随机变量 $X_{t-1}, X_{t-2}, \cdots, X_{t-k+1}$ 的条件下,或者说,在剔除了中间k-1个随机变量的干扰之后, X_{t-k} 对 X_t 影响的相关度量。用数学语言描述就是

$$\rho_{X_{t},X_{t-k}|X_{t-1},\cdots,X_{t-k+1}} = \frac{E[(X_{t} - \hat{E}X_{t})(X_{t-k} - \hat{E}X_{t-k})]}{E[(X_{t-k_{\text{n}}} - \hat{E}X_{t})^{2}_{\text{sdn. net/WMN7G}}]}$$

$$\begin{split} \rho_{X_{t},X_{t-k}|X_{t-1},\cdots,X_{t-k+1}} &= \frac{E[(X_{t} - \hat{E}X_{t})(X_{t-k} - \hat{E}X_{t-k})]}{E[(X_{t-k} - \hat{E}X_{t-k})^{2}} \\ & \sharp \div : \ \hat{E}X_{t} = E[X_{t} \, \big| X_{t-1},\cdots,X_{t-k+1}] \, , \, \hat{E}X_{t-k} = E[X_{t-k} \, \big| X_{t-1},\cdots,X_{t-k+1}] \end{split}$$

但是上面这个式子不能进行计算,我们经过化简,可以得到下面的等价的式子:下面矩阵中的pi就是滞后为i的自相关系数



至于化简的过程,可以查阅一下相关的资料,用到了k阶自回归拟合,还是有点复杂的。 我们可以将上面的过程用mma实现,当然mma中是有现成的函数的,我们就全当验证一下公式是否正确。 我们来计算一下{2,3,4,3,7}的滞后系数为3的偏自相关系数

1.首先计算他的1,2,3阶滞后的自相关系数

 $xs = CorrelationFunction[{2, 3, 4, 3, 7}, #] & /@ {1, 2, 3}$

$$\left\{-\frac{18}{185}, \frac{23}{370}, -\frac{14}{185}\right\}$$

http://blog.csdn.net/WMN70

2.接着生成如上的k*k的矩阵D和对于的Dk

```
<span style="font-size:18px;">x = Array[
    CorrelationFunction[{2, 3, 4, 3, 7}, Abs[#1 - #2]] &, {3, 3}];
x // MatrixForm
```

x // MatrixForm

|矩阵格式

ixForm=

$$\left(\begin{array}{cccc} 1 & -\frac{18}{185} & \frac{23}{370} \\ -\frac{18}{185} & 1 & -\frac{18}{185} \\ \frac{23}{370} & -\frac{18}{185} & 1 \end{array}\right)$$

http://blog.csdn.net/WMN76

xk = x;
xk[[All, 3]] = xs;
xk // MatrixForm

xk // MatrixForm

|矩阵格式

rixForm=
$$\begin{pmatrix} \mathbf{1} & -\frac{18}{185} & -\frac{18}{185} \\ -\frac{18}{185} & \mathbf{1} & \frac{23}{370} \\ \frac{23}{370} & -\frac{18}{185} & -\frac{14}{185} \end{pmatrix}$$

3.计算Dk/D

PartialCorrelationFunction[{2, 3, 4, 3, 7}, 3]
Det[xk]/Det[x]

PartialCorrelationFunction[{2, 3, 4, 3, 7}, 3]

[偏相关函数

Det[xk] / Det[x]

[行列式 [行列式

 $-\frac{1624946}{24778923}$

1 624 946 24 778 923

可以看到两者结果是一样的

http://blog.csdn.net/WMN70

上面的过程其实可以帮助我们更好的理解偏自相关系数的计算,我们把上面的过程总结成一个函数

```
<span style="font-size:18px;">pcorr[h_, list_] := Block[{xs, x, xk, lh},
    lh = Length[list];
    xs = CorrelationFunction[list, #] & /@ Range[lh - 1];
    x = Array[CorrelationFunction[list, Abs[#1 - #2]] &, {h, h}];
    xk = x;
    xk[[All, h]] = xs[[;; h]];
    Print["D矩阵: ", MatrixForm[x]];
    Print["D矩阵: ", MatrixForm[xk]];
    Print["使用自编函数: " <> ToString[N@Det[xk]/Det[x]]];
    Print["使用系统函数: " <> ToString[N@PartialCorrelationFunction[list, h]]];
    l</span>
```

这样在计算偏自相关系数的时候可以返回两个矩阵D和Dk,我们看一下效果

pcorr[3, {2, 3, 4, 5, 7, 9}]

D矩阵: $\begin{pmatrix} 1 & \frac{8}{17} & \frac{1}{34} \\ \frac{8}{17} & 1 & \frac{8}{17} \\ \frac{1}{34} & \frac{8}{17} & 1 \end{pmatrix}$

计算{2,3,4,5,7,9}滯后3的偏自相管系数

Dk矩阵: $\begin{pmatrix} 1 & \frac{8}{17} & \frac{8}{17} \\ \frac{8}{17} & 1 & \frac{1}{34} \\ \frac{1}{34} & \frac{8}{17} & -\frac{4}{17} \end{pmatrix}$

使用自编函数: -0.186645 使用系统函数: -0.186645

http://blog.csdn.net/WMN7Q

可以看到两者计算的结果是一样的,并且输出了两个矩阵。

最后欢迎关注我的微信公众号

公众号里除了会更新与博客上一样的文章外,还会增加一些我自己喜欢的电影分享之类的,欢迎大家关注。



以上,所有。

2017/4/15

,

第一批抓住微信流量红利机遇的成都人,现已赚翻啦!

宣凯商务·燨燚

1

想对作者说点什么

AR模型中的自相关系数和偏自相关系数 - weixin_42382211的博客

759

转:https://blog.csdn.net/WMN7Q/article/details/70174300自相关系数 其实自相关系数可以这么理解:把一列数据... 来自: weixin_42382211的博客

时间序列分析-python(一、自相关系数的意义) - qushoushi0594的博客

⊚ 2376

最近在学习时间序列预测销量,做一些笔记。参考:自相关系数根据自相关图判断AR/MA/ARMA模型平稳时间序列... 来自: qushoushi0594的博客

自相关函数与互相关函数 - dengheCSDN的博客

◎ 2.2万

1、概念 相关函数是描述信号X(s),Y(t)(这两个信号可以是随机的,也可以是确定的)在任意两个不同时刻s、t... 来自: dengheCSDN的博客



时间序列pvalue

百度广告

自相关函数的理解 - feng_shuai的博客

◎ 2.5万

作者:sky sailing 在学概率统计之前,我们学习的都是确定的函数。概率统计讨论了一次取值时获得的值是不确定... 来自:feng__shuai的博客

Matlab的autocorr自相关函数 - Ifdanding的专栏

◎ 2.6万

今天看了一下时间序列模型ARIMA模型,在对数据处理的时候,需要对其进行平稳性检验。对序列的平稳性的检验... 来自:Ifdanding的专栏

序列的自相关和互相关计算 - E-Note

◎ 3.4万

-- Ref [1] [2] [3] ------ 1.自相关和互相...

来自: E-Note

ARMA(模型)的p,q参数判定-既是0也是1的寻道书生

◎ 1.5万

AR(p)模型与MA(q)实际上是ARMA(p,q)模型的特例。它们都统称为ARMA模型,而ARMA(p,q)模型的统计性质也... 来自: 既是0也是1的寻道书生

互相关系数cross correlation-自相关系数-时间序列,图像-hpuyancy的专栏

9177

Cross Correlation AutoCorrelation -- 2D Pattern Identification Written by Paul Bourke August 1996 ... 来自: hpuyancy的专栏

金沙某老板一年败光干万家产,却在短短几个月赚到7位数!

驰垣投资·爔燚

自相关系数的一些问题 - QUANT zhang的专栏

@ 3134

一、自协方差和自相关系数 p阶自回归AR(p) 自协方差 r(t,s)=E[X(t)-EX(t)][X(s)-EX(s)] 自相关系数ACF=r(s,t)/[(DX(t)... 来自: QUANT_zhang的专栏

文章热词 机器学习 机器学习课程 机器学习教程 深度学习视频教程 深度学习学习

相关热词 c++ 自实现hastable c++ effective 自赋值 c#列自增加 c# 自动弹屏 c++自写集合 自兴人工智能课程 自兴人工智能培训

图像处理中振铃现象 - xiaoluo91的专栏

◎ 1.8万

图像处理中,对一幅图像进行滤波处理,若选用的频域滤波器具有陡峭的变化,则会使滤波图像产生"振铃",所谓"... 来自: xiaoluo91的专栏



钱塘小甲子

关注 203篇文章



关注 47篇文章



ProMath 关注 47篇文章



来自: WMN7Q的博客

wandaxiao66

关注 41篇文章

[时间序列分析][4]--AR模型,MA模型,ARMA模型介绍 - WMN7Q的博客

◎ 3万

自相关和偏自相关的两个函数代码 AR模型 AR模型的定义 AR模型平稳性判别 第一个平稳的AR模型 第二个平稳的A...

下载 ARMA模型的自相关函数和偏自相关函数图谱.pdf - jonsenhe

06-24

ARMA模型的自相关函数和偏自相关函数图谱.pdf

数理统计基础-相关系数 - Ontheway的博客

⊚ 1822

相关函数介绍: 相关系数(Karl Pearson系数)由卡尔*皮尔逊提出,广泛用于衡量两个变量线性相关程度的系数,... 来自: Ontheway的博客

金沙65岁大爷,玩手机赚钱3个月后惊人存款曝光!

乐本投资·燨燚

协方差矩阵和矩阵相关系数的理解 - 丑小鸭

© 653

在做机器学习的过程中经常会有矩阵的相关运算,这里就比较典型的协方差和矩阵的相关系数做个自我的理解记录... 来自: 丑小鸭

应用时间序列分析(王燕)学习笔记2 - NicolasHe的专栏

© 7855

时间序列的预处理拿到一个观察序列后,首先要对它的平稳性和纯随机性进行检验,这两个重要的检验称为序列的...

来自: NicolasHe的专栏

相关性计算 - silence2015的专栏

在做曲线相关性计算时候,一般都会考虑皮尔森系数(pearson correlation),这个皮尔僧系数其实就是计算两条曲线...

来自: silence2015的专栏

时间序列分析的matlab统计量函数1 - duanyajun987的博客

⊚ 2739

mad 功能:计算时间序列的平均绝对偏差 格式: y = mad(x) % 计算时间序列x的平均绝对偏差,即mean(abs(X-... 来自: duanyajun987的博客

我在浙江财经大学的一年 - Irish_Moonshine的博客

⊚ 1264

印象中第一次正式的面试是在开学之初,是关于现代经济学实验班的录取。起初,收到浙江财经大学录取通知书的... 来自: Irish_Moonshine的博客

金沙某富二代败光干万家产,却在短短几个月赚到7位数!

兰坤投资·燨燚

普通运维人员就是秋后的蚂蚱! - alex3714的专栏

我虽是一个IT屌丝,但特别喜欢关注整个大行业的动态,干IT运维相关工作到现在也快8年了,企业对运维人员的... 来自: alex3714的专栏

多元线性回归-Part1(以医疗费用为例)-Luz_Data_Scientist的博客

789

相较于一元线性回归,多元线性回归是用来确定2个或2个以上变量间的统计分析方法,其基本的分析方法和一元线... 来自:Luz_Data_Scientist的博客

自相关函数 - qq_30468339

介绍了自相关函数的MATLAB实现,及应用实例。

自相关函数估计 - weixin 42043175

首先产生一段零均值高斯白噪声,再叠加三个正弦信号,采用FFT快速计算和直接估计分别估计自相关函数

如何通俗易懂地理解皮尔逊相关系数? - 黄飞的博客专栏

⊚ 13F

要理解 Pearson 相关系数,首先要理解协方差(Covariance)。协方差表示两个变量 X, Y 间相互关系的数字特征... 来自:黄飞的博

金沙某老板一年败光干万家产,却在短短几个月赚到7位数!

磊玺投资·燨燚

机器学习笔记——皮尔逊相关系数 - 三分地

© 5568

在学到相关性度量的时候,有一个系数用来度量相似性(距离),这个系数叫做皮尔逊系数,其实在统计学的时候就已... 来自: 三分地

典型关联分析CCA (canonical correlation analysis) - 风翼冰舟的博客

@ 9844

先看两个数学概念: 相关系数(参看百度百科) 相关系数是用以反映变量之间相关关系密切程度的统计指标。... 来自:风翼冰舟的博客

下载 基于Python自相关法时间序列的时间延迟计算 - 沙漠火狼

02-11

基于Python自相关法时间序列的时间延迟计算,用matlab程序翻译成python并修改调试成功,很辛苦的额。 用于混沌系统、故障诊断等的相空间重构中的时间延迟计算。

Matlab 超前滞后相关,自相关xcorr - ProMath的专栏

◎ 3097

Matlab提供了计算互相关和自相关的函数xcorr函数 1.使用方法 c = xcorr(x,y) c = xcorr(x) c = xcorr(x,y,'option') c = x... 来自: ProMath的专栏

C++ vector 计算自相关性函数selfcorr - wandaxiao的专栏

来自: wandaxiao的专栏 简单实现如下: template void selfcorr(vector src, vector& dst){ size_t len = src.size(); for(size_t i...

勃不起来?老中医说:多吃它,时间延长30分钟!

美皙·燨燚

R做相关系数图 - Blackrosetian的博客

© 1243

来自: Blackrosetian的博客

Function Package Description plotcorr ellipse 以椭圆代表相关系数。 plotcov pcaPP ...

[偏相关分析]偏相关系数计算及假设检验 - 女王的code

3798

1、相关分析通过计算两个变量之间的相关系数,分析变量间线性相关的程度,在多元相关分析中,由于受到其他变... 来自:女王的code

R-时间序列自相关acf,偏自相关pacf-u012543538的专栏

⊚ 1.8万

关于自相关、偏自相关: 一、自协方差和自相关系数 p阶自回归AR(p) 自协方差 r(t,s)=E[X(t)-EX(t)][X(s)-EX... 来自: u012543538的专栏

偏相关函数 - aihali的专栏

1760

偏相关分析是指当两个变量同时与第三个变量相关时,将第三个变量的影响剔除,只分析另外两个变量之间相关程... 来自: aihali的专栏

时间序列分析之AR模型、MA模型和ARMA模型(二)-雨后的夜

◎ 2万

此学习笔记来自于王燕老师编著的《时间序列分析-基于R》 对一个时间序列预处理后检验出该序列为平稳时间... 来自:雨后的夜

金沙某富二代败光千万家产,却在短短几个月赚到7位数!

义昂投资·燨燚

[转]自相关系数 - 网络知识精读

1894

转自http://blog.sina.com.cn/s/blog_4af43a0e0100b05f.html 这个是信号分析里的概念,他们分别表示的是两个时... 来自:网络知识精读

时间序列之AR(自回归模型) - 既是0也是1的寻道书生

◎ 2.4万

一个序列经过预处理被识别为平稳非白噪声序列,那就说明该序列是一个蕴含着相关信息的平稳序列。在统计上我... 来自: 既是0也是1的寻道书生

使用R计算相关系数 - 立身以力学为先, 力学以读书为本。 —郑耕老《劝学》

http://zoonek2.free.fr/UNIX/48_R/09.html 使用R计算相关系数的函数为: cor.test(X,Y,method="") method可以为"sp... 来自: 立身以力学为先,力学以...

机器学习(多元线性回归)-zoinsung lee的博客

@ 3262

1.与简单线性回归的区别 多个自变量 (x) 2.多元回归模型 y= β0+ β1*x1+ β2*x2+.......+ βp*xp+e 其中 β1 , β2 , ... 来自: zoinsung_lee的博客

机器学习回归篇-多元线性回归 - 无风而起的博客

© 6366

来自:无风而起的博客

多简单线性回归相比,多元线性回归不过是多了几个自变量x

金沙63岁大爷,玩手机赚钱3个月后惊人存款曝光!

正寒联创·爔燚

matlab相关系数计算 - weixin_42124051的博客

a ..-

一、相关系数 具体的理论知识参见其他气象统计学教材。简单的说,相关系数r就是求两个大小相同样本的相关... 来自: weixin_42124051

链接: https://pan.baidu.com/s/1jILU9YA 密码: xg3e - qq_29257691的博客

© 24 9

vue.js 来自: qq_29257691的博客

SuperSearch(超级网搜) - BooMWorks

◎ 2.5万

软件简介(Introduction)免费、轻量、快速的多引擎搜索工具,拥有详细的搜索分类。免费:无须注册,无任何功能... 来自:BooMWorks

8核、6核、4核、双核CPU是什么意思 - he_jian1的专栏

◎ 38.7万

对于初学者来说,CPU是什么、什么是双核、4核、6核、8核等。下面,就以上的问题,我们做出——解答。 故障… 来自: he_jian1的专栏

时间序列分析这件小事(二)--自回归 - lyx的专栏

⊚ 4952

说到时间序列,那么就必须提起自回归了。什么是自回归呢,就是说未来的一个时点可以用之前的时点来进行回归... 来自: lyx的专栏



时间序列work01-solutions

百度广告

算法--偏差,方差,标准差,协方差,相关系数及相关理解 - 齐天大圣徐的博客

1偏差与方差偏差(bias):描述的是预测值(估计值)的期望与真实值之间的差距。偏差越大,越偏离真实数据... 来自: 齐天大圣徐的博客

matlab 两个序列的相关系数 - 依恋冰雪的博客

◎ 1.8万

Pearson相关系数用来衡量两个数据集合是否在一条线上面。其计算公式为: 相关系数r取值在-1到1之间,r = 0时... 来自: 依恋冰雪的博客

ENVI中求两幅影像的相关系数 - 心灵深处的那片净土

© 6251

要求相关系数,必须先将两个或者波段合成(Layer Stacking)

来自:心灵深处的那片净土

06-19

下载 求取图像的相关系数---matlab ---M文件 - gisvc

有关于求取图像相关系数的matlab M 文件;虽然很简单,但可以为你省去那么一点时间。 共享改变未来!

数字信号处理中的自相关和互相关计算和物理意义 (一) - 坚持

◎ 1.2万

1.首先说说自相关和互相关的概念。 这个是信号分析里的概念,他们分别表示的是两个时间序列之间和同一个时... 来自:坚持



一款App的开发成本是多少

百度广告

时间序列分析的matlab自相关函数autocorr - bxk88的博客

◎ 1.3万

autocorr 功能: 计算并描绘时间序列的自相关函数 格式: autocorr(Series,nLags,M,nSTDs) % 计算并绘制单变量随... 来自: bxk88的博客



Hadoop权威指南:大数据的存储与分析(第4版)

本书结合理论和实践,由浅入深,全方位介绍了Hadoop这一高性能的海量数据处理和分析平台。全书5...



https://blog.csdn.net/wmn7q/article/details/70174300

关注

原创 粉丝 喜欢 评论 134 157 19 47

等级: 博名 5 访问: 29万+ 积分: 3724 排名: 1万+

勋章: 睻 📵



我的个人博客

欢迎访问我的个人博客

文艺数学君

文艺数学君群号:611673340

微信,微博搜索 文艺数学君,欢迎关注

最新文章

python使用flask和bootstrap制作网站

ubuntu下安装最新redis

selenium的一些要注意的地方

pandas时间序列操作

python的dataframe转换为多维矩阵

博主专栏



使用mathematica实现时间序列

分析

阅读量:96912 6篇

个人分类

wolfram语言入门	1篇
数学/数学排版	7篇
回归分析	17篇
时间序列分析	6篇
mathematica数据分析画图	13篇

展开

ļ	J	ł	Ë	ĺ	

2017年11月		9篇
2017年10月		10篇
2017年9月		2篇
2017年8月		9篇
2017年7月		6篇
	展开	

热门文章

[时间序列分析][3]--自相关系数和偏自相关 系数

阅读量:36833

[时间序列分析][4]--AR模型,MA模型,ARMA 模型介绍

阅读量:29910

[时间序列分析][1]--平稳性,白噪声的检验

阅读量:14174

关于如何使用按钮(onclick)打开链接

阅读量:12098

关于Markdown里的图片并排显示

阅读量:11307

最新评论

Mathematica数据处理(1...

qq_27576655: 三维点的怎么样显示?

[计算机组成原理]--关于磁盘平均...

qq_37457202: 谢谢 博主 写得真好

[时间序列分析][2]--趋势和(...

weixin_38317333: 以前忙着看过程, 今天仔细看

了看文字, 艾玛, 你要笑死我了

Mathematica图像处理(6..

qq_43040372: 感觉整不会啊 能不能教一下

Q729153821

Python3中dict.keys...

kg201310501321:简单易懂,太实用



联系我们





微信客服

QQ客服

■ QQ客服

■ kefu@csdn.net

● 客服论坛

2 400-660-0108

工作时间 8:00-22:00

关于我们 招聘 广告服务 网站地图

╬ 百度提供站内搜索 京ICP证09002463号 ©1999-2018 江苏乐知网络技术有限公司 江苏知之为计算机有限公司 北京创新乐知 信息技术有限公司版权所有

网络110报警服务 经营性网站备案信息 北京互联网违法和不良信息举报中心 中国互联网举报中心