

ARIMA 모델

○ ARIMA

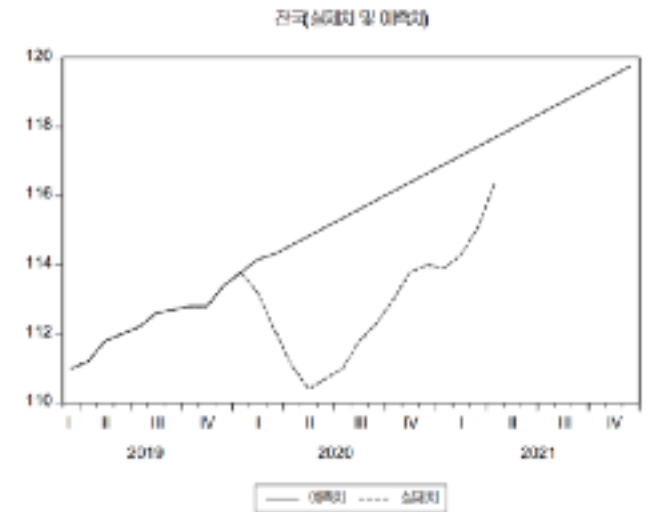
과거지식이나 경험을 바탕으로
경제가 움직인다고 간주하고
이를 기반으로 예측하는 모델

$$X_t - \varphi_1 X_{t-1} - \dots - \varphi_p X_{t-p} = Z_t + \theta_1 Z_{t-1} + \dots + \theta_q Z_{t-q},$$

$$t = 0, \pm 1, \pm 2, \dots$$

- X_t : ARIMA를 통해 예측하고자 하는 데이터
- Z_t : 백색잡음(White Noise), 독립적이고 동일하게 분산된 (IID) 확률 변수

경제적 충격에 따른 지역경제 회복력 연구*
- 글로벌 금융위기 및 코로나19를 중심으로 -



ARIMA 모델

○ 변수 선정

KOSPI 200

**시장의 대표성을 띤 지수
KOSPI에 비해 시장을 왜곡해서
해석할 가능성이 낮음**