

ΠΟΛΥΤΕΧΝΕΙΟ ΚΡΗΤΗΣ ΓΕΝΙΚΟ ΤΜΗΜΑ



ΠΡΟΓΡΑΜΜΑ ΜΕΤΑΠΤΥΧΙΑΚΩΝ ΣΠΟΥΔΩΝ ΕΦΑΡΜΟΣΜΕΝΕΣ ΕΠΙΣΤΗΜΕΣ ΚΑΙ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΑ

**ΔΙΠΛΩΜΑΤΙΚΗ ΔΙΑΤΡΙΒΗ ΜΕΤΑΠΤΥΧΙΑΚΟΥ ΔΙΠΛΩΜΑΤΟΣ ΕΙΔΙΚΕΥΣΗΣ
ΚΑΤΕΥΘΥΝΣΗ : «ΕΦΑΡΜΟΣΜΕΝΑ ΚΑΙ ΥΠΟΛΟΓΙΣΤΙΚΑ ΜΑΘΗΜΑΤΙΚΑ»**

ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΤΗΣ ΜΕΘΟΔΟΥ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ ΣΤΗΝ ΠΡΟΒΛΕΨΗ ΠΑΡΑΓΩΓΗΣ ΠΕΤΡΕΛΑΙΟΥ

ΠΑΠΑΔΟΠΟΥΛΟΥ ΓΕΩΡΓΙΑ

Επιβλέπων: Επίκουρος Καθηγητής **Δάρας Τρύφων**

ΧΑΝΙΑ, 2015

Περιεχόμενα

ΕΙΣΑΓΩΓΗ iii

I ΑΝΑΛΥΣΗ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ 1

1 ΒΑΣΙΚΕΣ ΕΝΝΟΙΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ 3

- 1.1 Η ΕΝΝΟΙΑ ΤΗΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΑΣ 3
- 1.2 ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΑ ΜΕΓΕΘΗ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ 5
 - 1.2.1 ΜΕΣΗ ΤΙΜΗ 5
 - 1.2.2 ΑΥΤΟΣΥΝΔΙΑΚΥΜΑΝΣΗ 5
 - 1.2.3 ΑΥΤΟΣΥΣΧΕΤΗΣΗ 5
- 1.3 ΣΤΑΣΙΜΟΤΗΤΑ 5
 - 1.3.1 ΣΤΑΣΙΜΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΕΣ 5
 - 1.3.2 ΟΜΟΓΕΝΕΙΣ ΜΗ-ΣΤΑΣΙΜΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΕΣ 5
- 1.4 ΕΡΓΟΔΙΚΟΤΗΤΑ 5
- 1.5 ΠΡΩΤΑ ΣΤΑΔΙΑ ΑΝΑΛΥΣΗΣ 5

2 Όνομα δεύτερου κεφαλαίου 7

- 2.1 Όνομα πρώτης ενότητας 7
 - 2.1.1 Όνομα πρώτης υποενότητας 7
- 2.2 Όνομα δεύτερης ενότητας 7

II ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΓΙΑ ΤΗΝ ΠΡΟΒΛΕΨΗ ΠΑΡΑΓΩΓΗΣ ΠΕ- ΤΡΕΛΑΙΟΥ 9

3 Όνομα τρίτου κεφαλαίου 11

- 3.1 Όνομα πρώτης ενότητας 11
 - 3.1.1 Όνομα πρώτης υποενότητας 11
- 3.2 Όνομα δεύτερης ενότητας 11

Βιβλιογραφία 13

ΕΙΣΑΓΩΓΗ

Εδώ η Γεωργία θα γράψει την εισαγωγή της. Στην πορεία θα συζητήσουμε την δομή της εισαγωγής [3]. Πρέπει η εισαγωγή να έχει παρόμοιο θεματικό σκελετό με την [2, 1] περίληψη και τα συμπεράσματα στο τέλος της εργασίας.

Το αντικείμενο είναι λοιπόν η ανάλυση χρονοσειρών, δηλαδή η χρήση μεθόδων που θα μας επιτρέψουν να διερευνήσουμε το μηχανισμό (στοχαστική διαδικασία ή δυναμικό σύστημα) που παράγει τη χρονοσειρά, να εκτιμήσουμε χαρακτηριστικά του, να αναπτύξουμε μοντέλο για να το περιγράψουμε και να κάνουμε προβλέψεις της εξέλιξης του, δηλαδή τις επόμενες τιμές στη χρονοσειρά.

Γ. Παπαδοπούλου, Χανιά 2015.

Μέρος Ι

ΑΝΑΛΥΣΗ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ

Κεφάλαιο 1

ΒΑΣΙΚΕΣ ΕΝΝΟΙΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ

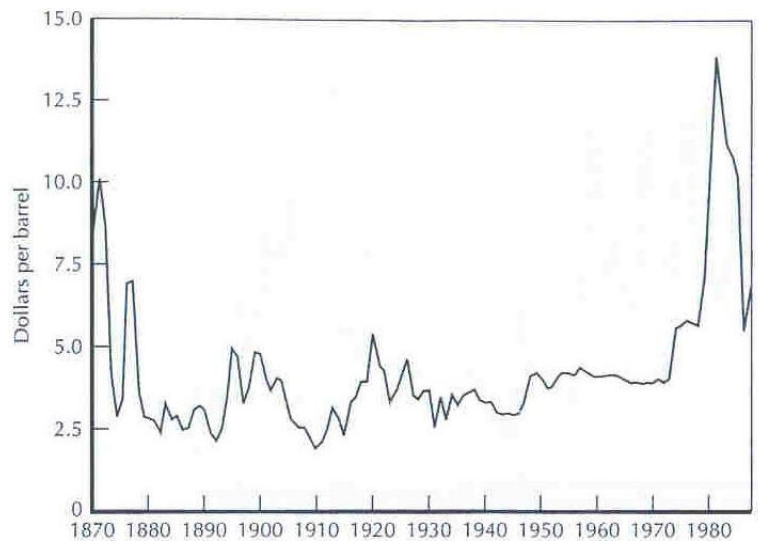
1.1 Η ΕΝΝΟΙΑ ΤΗΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΑΣ

Η χρονοσειρά μπορεί να ορισθεί ως μια συλλογή διαδοχικών χρονικών παρατηρήσεων της τιμής κάποιου μεγέθους. Πρόκειται ουσιαστικά για μια στοχαστική διαδικασία, μιας και η εξέλιξη των τιμών του μεγέθους επηρεάζεται από τυχαίους παράγοντες, ενώ η τιμή κάθε χρονικής στιγμής συνιστά και μια ξεχωριστή τυχαία μεταβλητή. Με τον όρο χρονοσειρά, δηλαδή εννοούμε συνήθως μια ακολουθία $X_t : t = 0, 1, 2, \dots$, όπου κάθε X_t εκφράζει την κατά την χρονική στιγμή t κατάσταση ενός συστήματος το οποίο εξελίσσεται στο χρόνο κατά τυχαίο εν γένει τρόπο (stochastic system). Παραδείγματα τέτοιων χρονοσειρών είναι:

- (i) Οι ημερήσιες, αεροπορικές και οδικές, αφίξεις τουριστών στην χώρα μας X_t με $t = 1, 2, \dots$
- (ii) Ο αριθμός X_t πελατών μέσα σε ένα πολυκατάστημα κατά τη χρονική στιγμή t με $t \in [0,]$.
- (iii) Ο συνολικός αριθμός τροχαίων ατυχημάτων X_t κατά μήκος μιας οδικής αρτηρίας στο χρονικό διάστημα $[0, t]$ με $t \geq 0$.
- (iv) Η ημερήσια κατανάλωση ηλεκτρικού ρεύματος καθώς και η ημερήσια κατανάλωση ύδατος, X_t και Y_t αντίστοιχα, σε μια μεγάλη γεωγραφική περιοχή της χώρας με $t = 1, 2, \dots$
- (v) Οι οικονομικές χρονοσειρές, όπως το ετήσιο ακαθάριστο εθνικό προϊόν και ετήσιο ισοζύγιο εξωτερικών συναλλαγών X_t και Y_t αντίστοιχα, με $t = 1, 2, \dots$
- (vi) Οι μετεωρολογικές χρονοσειρές, όπως η θερμοκρασία περιβάλλοντος και ατμοσφαιρική πίεση, X_t και Y_t αντίστοιχα, σε συγκεκριμένη γεωγραφική περιοχή με γεωγραφικές συντεταγμένες (l, a, h) κατά την χρονική στιγμή t . Εδώ η χρησιμοποιούμενη παράμετρος t είναι περισσότερο σύνθετη και συγκεκριμένα $t = (l, a, h, t)$.

Όπως διαπιστώνει κανείς από τα παραπάνω παραδείγματα, οι χρονοσειρές μπορούν να αφορούν *διακριτά* μεγέθη X_t σε *διακριτό* χρόνο t , περίπτωση (i), *διακριτά* μεγέθη X_t σε *συνεχή* χρόνο t , περιπτώσεις (ii) και (iii), *συνεχή* μεγέθη X_t σε *διακριτό* χρόνο t , περιπτώσεις (iv) και (v) και *συνεχή* μεγέθη X_t σε *συνεχή* χρόνο t , περίπτωση (vi). Το πρόβλημα είναι η “πρόβλεψη” μελλοντικών τιμών της χρονοσειράς με βάση τις μέχρι σήμερα τιμές της ίδιας χρονοσειράς, περιπτώσεις (i)–(iii), είτε ακόμα και σε συνδυασμό με τις μέχρι σήμερα τιμές μιας άλλης χρονοσειράς η οποία εξελίσσεται παράλληλα με την πρώτη και επιδρά πάνω σ’ αυτή, περιπτώσεις (iv)–(vi), οπότε μιλάμε για *πολυμεταβλητές χρονοσειρές*. Το σύνολο των δυνατών καταστάσεων ονομάζεται *χώρος καταστάσεων* και συμβολίζεται με S , ένα (μονοδιάστατο) υποσύνολο του R , ή γενικότερα ένα πολυδιάστατο υποσύνολο του R^d , ενώ το σύνολο τιμών του t ονομάζεται *παραμετρικός χώρος*, συμβολίζεται με T και μπορεί επίσης να είναι υποσύνολο του R^k , όταν χρειάζεται ένα πολυδιάστατο t για να καθορίσουμε πέραν του χρόνου t και γεωγραφικές π.χ. συντεταγμένες (l, a, h) σε χωρο-χρονοσειρές (spatial time series), βλ. παράδειγμα (vi) παραπάνω. Σημειώνεται οι όροι *διακριτά* και *συνεχή* μεγέθη είναι σε αντιστοιχία με τους όρους *διακριτές* και *συνεχείς* τυχαίες μεταβλητές.

Ένα παράδειγμα μίας χρονοσειράς απεικονίζεται στο ακόλουθο σχήμα 1.1 όπου παρουσιάζεται το γράφημα της ετήσιας τιμής του αργού πετρελαίου σε αμερικανικά δολάρια ανά βαρέλι.



Σχήμα 1.1: Γράφημα χρονοσειράς τιμής αργού πετρελαίου σε δολάρια ανά βαρέλι.

Ο χρονικός ορίζοντας είναι 117 χρόνια, από το έτος 1870 έως το έτος 1987, ενώ ως έτος βάσης έχει θεωρηθεί το 1967. Το γράφημα ελήφθη από το βιβλίο των R. Pindyck και D. Rubinfeld (1998).

Η συστηματική μελέτη μιας χρονοσειράς ξεκινάει με την επισκόπηση του γραφήματός της στο πεδίο του χρόνου, από το οποίο μπορούν αρχικά να ανιχνευθούν τρία βασικά ποιοτικά χαρακτηριστικά της: Η τάση, η εποχικότητα και οι ακραίες παρατηρήσεις.

- Η **τάση** (trend) γενικά θα μπορούσε να ορισθεί ως η μακροπρόθεσμη μεταβολή του μέσου επιπέδου των τιμών μιας χρονοσειράς. Έτσι, μπορεί η τάση των τιμών να είναι αυξητική, πτωτική ή σταθερή σε ένα συγκεκριμένο χρονικό διάστημα, ενώ μπορεί και να έχει τη μορφή κάποιας συνάρτησης στο εν λόγω διάστημα. Να σημειωθεί ότι η έννοια “μακροπρόθεσμη μεταβολή” εξαρτάται από την εκάστοτε εφαρμογή που εξετάζεται.
- Η **εποχικότητα** (seasonal) μπορεί να ορισθεί σαν μια περιοδική διακύμανση που έχει σταθερό μήκος. Η εν λόγω διακύμανση τις περισσότερες φορές διακρίνεται εύκολα και μπορεί να ερμηνευθεί στα πλαίσια του υπό μελέτη φαινομένου. Φερ’ ειπείν, αν κανείς επιθυμούσε να αναλύσει τη χρονοσειρά των τιμών των καυσίμων σε βάθος χρόνων, είναι λογικό να περιμένει να παρατηρήσει μια σχετική άνοδο κατά τους χειμερινούς μήνες κάθε έτους.
- Οι **ακραίες παρατηρήσεις** (outliers) είναι οι απομονωμένες παρατηρήσεις που εμφανίζονται στο γράφημα κάποιας χρονοσειράς ως απότομες αλλαγές στο πρότυπο συμπεριφοράς της. Τα outliers μελετήθηκαν αρχικά κατά κύριο λόγο από τον A. J. Fox (1972), ο οποίος μάλιστα εισήγαγε δύο τύπους. Ο τύπος I αφορά περιπτώσεις όπου η ύπαρξη μιας ακραίας τιμής δεν έχει καμία επίδραση στις ακόλουθες παρατηρήσεις. Αντιθέτως, ο τύπος II αφορά περιπτώσεις όπου υπάρχει επίδραση στη μετέπειτα συμπεριφορά των τιμών της χρονοσειράς, παράγοντας μια σειρά λιγότερο ή περισσότερο ακραίων παρατηρήσεων ή αλλάζοντας εξ’ ολοκλήρου τα χαρακτηριστικά της.

1.2 ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΑ ΜΕΓΕΘΗ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΩΝ

1.2.1 ΜΕΣΗ ΤΙΜΗ

1.2.2 ΑΥΤΟΣΥΝΔΙΑΚΥΜΑΝΣΗ

1.2.3 ΑΥΤΟΣΥΣΧΕΤΗΣΗ

1.3 ΣΤΑΣΙΜΟΤΗΤΑ

1.3.1 ΣΤΑΣΙΜΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΕΣ

1.3.2 ΟΜΟΓΕΝΕΙΣ ΜΗ- ΣΤΑΣΙΜΕΣ ΧΡΟΝΟΣΕΙΡΕΣ

1.4 ΕΡΓΟΔΙΚΟΤΗΤΑ

1.5 ΠΡΩΤΑ ΣΤΑΔΙΑ ΑΝΑΛΥΣΗΣ

Κεφάλαιο 2

Όνομα δεύτερου κεφαλαίου

2.1 Όνομα πρώτης ενότητας

2.1.1 Όνομα πρώτης υποενότητας

2.2 Όνομα δεύτερης ενότητας

Μέρος II

**ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΓΙΑ ΤΗΝ
ΠΡΟΒΛΕΨΗ ΠΑΡΑΓΩΓΗΣ
ΠΕΤΡΕΛΑΙΟΥ**

Κεφάλαιο 3

Όνομα τρίτου κεφαλαίου

3.1 Όνομα πρώτης ενότητας

3.1.1 Όνομα πρώτης υποενότητας

3.2 Όνομα δεύτερης ενότητας

Βιβλιογραφία

- [1] C. Li. Chen and A.C. Reynolds. Robust constrained optimization of short- and long-term net present value for closed-loop reservoir management. *SPE Journal*, 17(3):849–864, 2012.
- [2] Jan Dirk Jansen. *A Systems Description of Flow Through Porous Media*. SpringerBriefs in Earth Sciences, 2013.
- [3] Drosos Kourounis, Louis J. Durlofsky, Jan Dirk Jansen, and Khalid Aziz. Adjoint formulation and constraint handling for gradient-based optimization of compositional reservoir flow. *Computational Geosciences*, pages 1–21, 2014.