

Séries Temporais e Análises Preditivas

AUTOCORRELAÇÃO

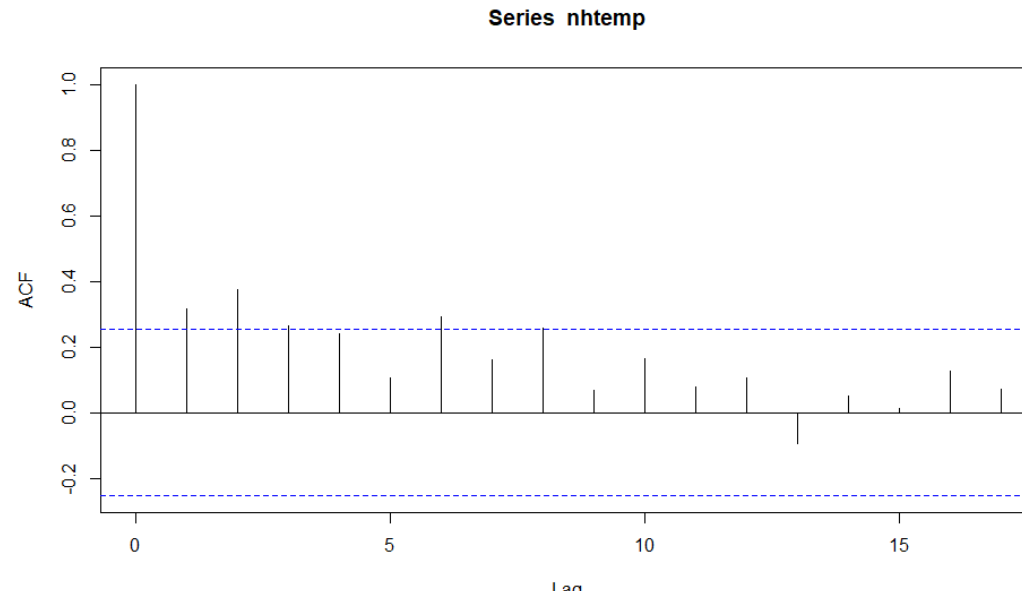
Autocorrelação

- Mede se existe uma relação matemática entre os intervalos da série temporal
- Também deve ser estar entre 1 e -1, sendo zero a ausência de autocorrelação
- Medida em intervalos (lag):
 - De 1 intervalo: mede como valores de 1 período distantes estão relacionados
 - De 2 intervalos: mede como valores de 2 períodos distantes estão relacionados



Autocorrelação - ACF

- Mostra a autocorrelação em uma serie temporal

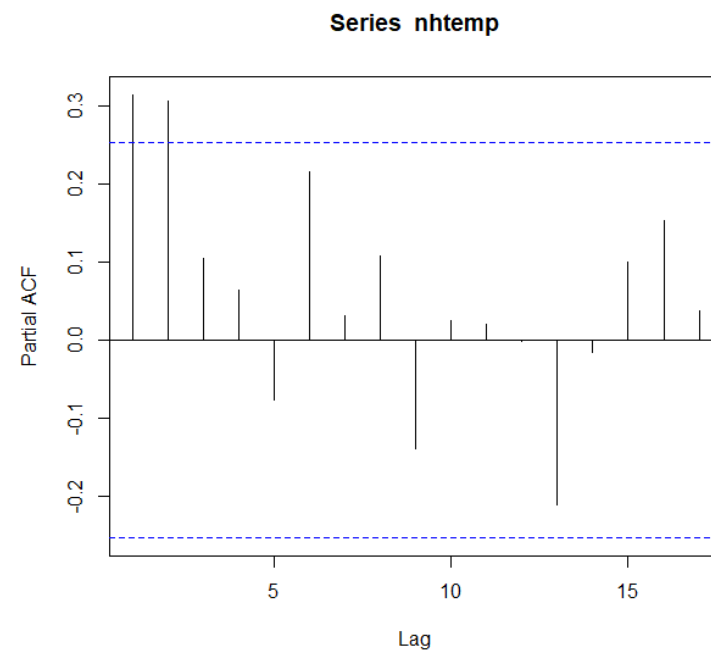


Autocorrelations of series 'nhtemp', by lag

0	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
1.000	0.315	0.375	0.264	0.241	0.106	0.292	0.161	0.259	0.068	0.165	0.077	0.107	-0.094	0.051	0.011	0.126	0.073

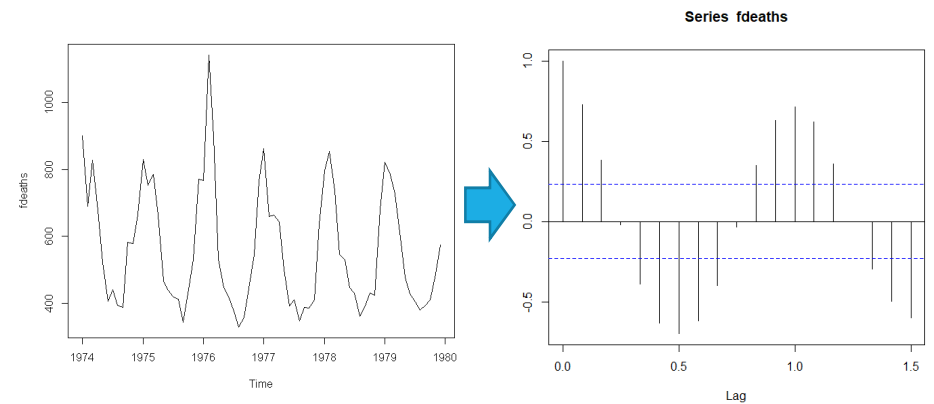
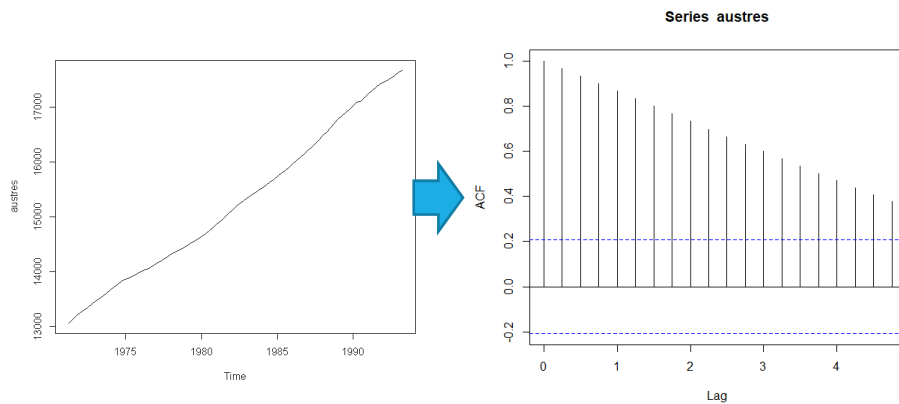


PACF



Com sazonalidade e Tendência

- Com tendência: Tende a ser grande e positiva
- Com sazonalidade: Tende a ser maior nos intervalos com maiores valores



Ruído Branco (white noise)

- Serie Temporal que não apresenta autocorrelação
- Se mais de 5% dos intervalos estiverem fora da linha azul, não é white noise

