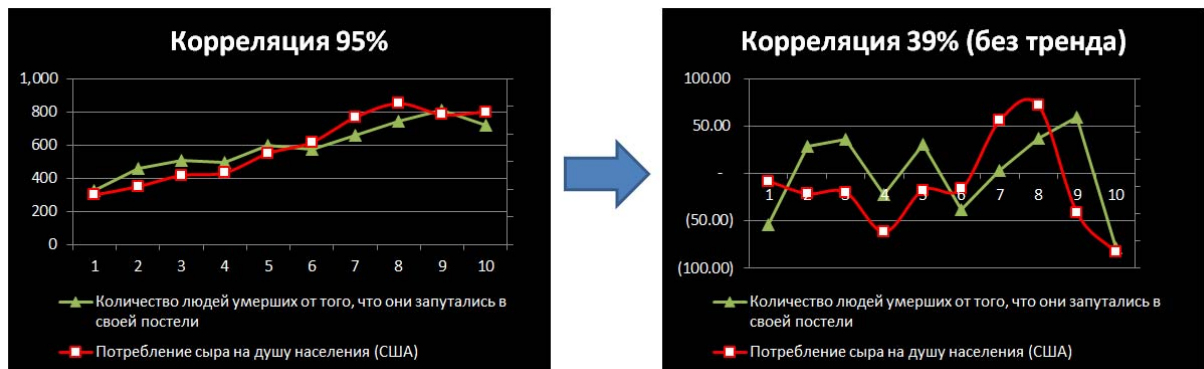


Лабораторная работа №1. Взаимная корреляция случайных процессов

Задание

На сайте <http://www.tylervigen.com/spurious-correlations> выбрать два динамических ряда, построить графики, оценить ложную корреляцию между переменными. Удалить тенденции роста (снижения). Рассчитать взаимную корреляцию по остаткам.

Пример



Среда реализации

MS Excel, любая среда программирования.

Отчет оформлять необязательно. Сдать нужно файл с расчетами и результатами.

Защита лабораторной работы – по соответствующим разделам: корреляция, ковариация, причины возникновения ложной корреляции.