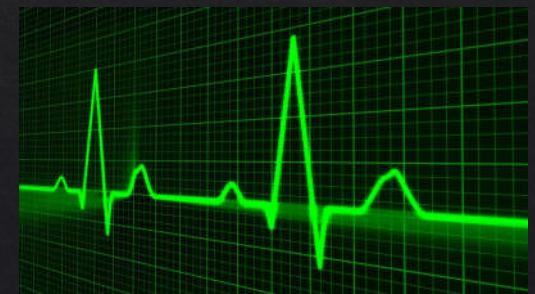


# Autocorrelação

- ◆ 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

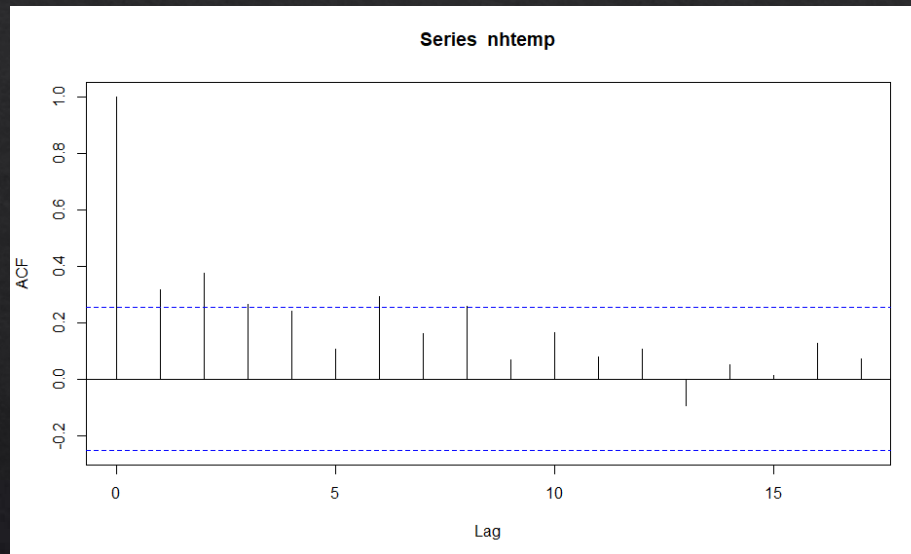


FERNANDO  
AMARAL  
www.datascientist.com.br



# Autocorrelação - ACF

- ◆ Mostra a autocorrelação em uma serie temporal



Linhas mostram significância  
(intervalo de confiança)

Autocorrelations of series 'nhtemp', by lag

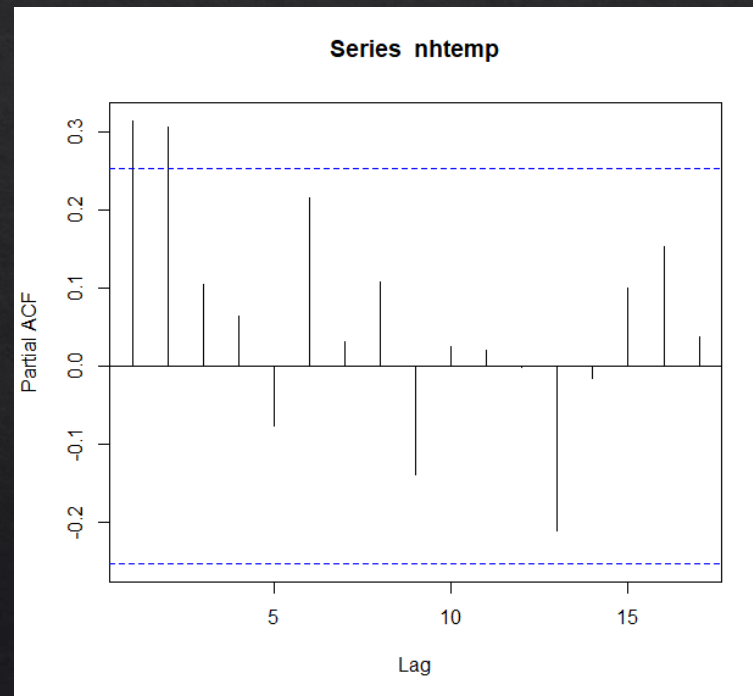
0	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17
1.000	0.315	0.375	0.264	0.241	0.106	0.292	0.161	0.259	0.068	0.165	0.077	0.107	-0.094	0.051	0.011	0.126	0.073

DO



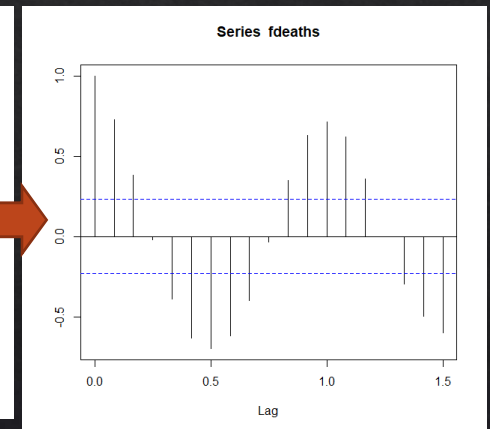
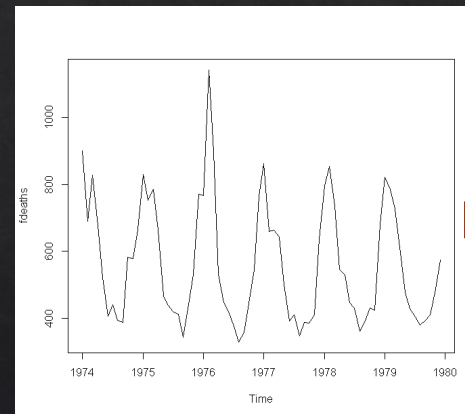
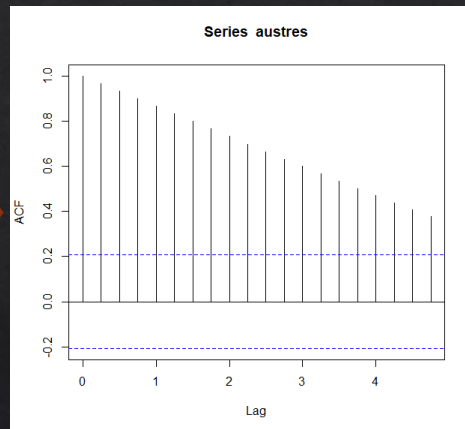
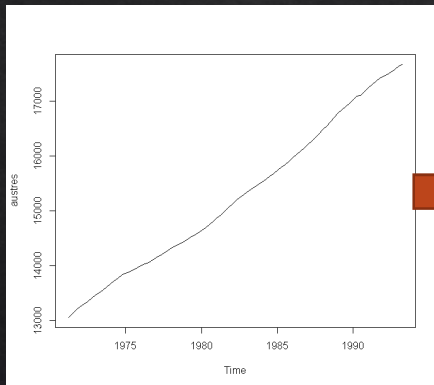
AMARAL  
www.datascientist.com.br

# 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 autocorreção
- ◇ Se mais de 5% dos intervalos estiverem fora da linha azul, não é white noise

