



Ekonomické časové řady

Sezónní očištění časových řad

Sezónní složka časové řady

- Pravidelně se opakující odchylka od trendové složky
- Cílem je složku identifikovat, kvantifikovat a následně vyloučit – sezónní očišťování

Sezónní očišťování

Pomocí metody sezónních faktorů:

- Stanovit periodicitu sezónosti
- Vyrovnání hodnot v časové řadě (trend, klouzavý průměr)
- Výpočet sezónních indexů (poměr vyrovnané a empirické hodnoty)
- Výpočet sezónního faktoru (standardizace sezónních indexů)

Cyklická a náhodná složka

- Cyklická složka – analýzy vycházejí ze složitých postupů (Fourierova analýza harmonických složek)
- Náhodná složka – náhodná veličina – lze uplatnit poznatky z teorie NV

Požadavek na náhodnou složku – neexistence autoregrese náh. složek

Autoregrese náhodných složek

- Měří se pomocí **Durbin-Watsonova testu autoregrese**
- Kritérium

$$d = \frac{\sum_{i=1}^{12} (\varepsilon_t - \varepsilon_{t-1})^2}{\sum_{i=1}^{12} \varepsilon_t^2}$$

- ε_t a ε_{t-1} – náhodné složky časové řady
- Hodnoty D-W: <0; 4>
 - závislost - Hodnoty blíží se 0 nebo 4
 - nezávislost - Hodnoty blíží se 2