

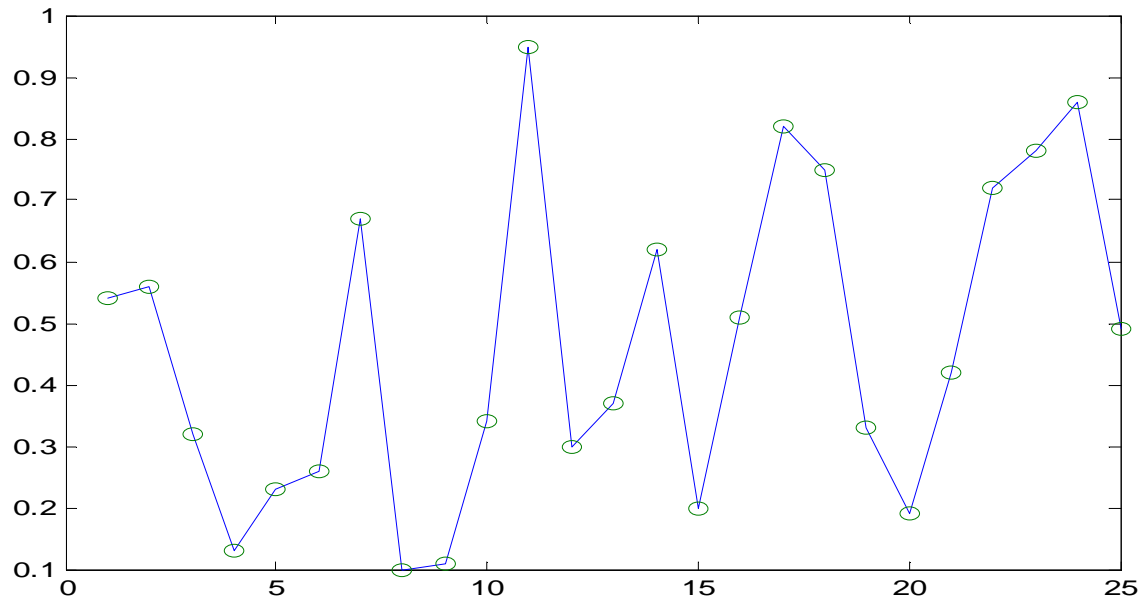
Ukázka testování autokorelace 1. až k-tého řádu

Bylo vygenerováno 25 čísel z $R_s(0,1)$:

$10^{-2}(54\ 56\ 32\ 13\ 23\ 26\ 67\ 10\ 11\ 34\ 95\ 30\ 37\ 62\ 20\ 51\ 82\ 75\ 33\ 19\ 42\ 72\ 78\ 86\ 49)$

Na hladině významnosti 0,05 proveďte testy autokorelace 1. až 6. řádu.

Graf:



Řešení:

Tabulka pro výpočet koeficientů autokorelace 1. až 6. řádu:

	1 $x(i)$	2 $x(i+1)$	3 $x(i+2)$	4 $x(i+3)$	5 $x(i+4)$	6 $x(i+5)$	7 $x(i+6)$
1	0,54	0,56	0,32	0,13	0,23	0,26	0,67
2	0,56	0,32	0,13	0,23	0,26	0,67	0,1
3	0,32	0,13	0,23	0,26	0,67	0,1	0,11
4	0,13	0,23	0,26	0,67	0,1	0,11	0,34
5	0,23	0,26	0,67	0,1	0,11	0,34	0,95
6	0,26	0,67	0,1	0,11	0,34	0,95	0,3
7	0,67	0,1	0,11	0,34	0,95	0,3	0,37
8	0,1	0,11	0,34	0,95	0,3	0,37	0,62
9	0,11	0,34	0,95	0,3	0,37	0,62	0,2
10	0,34	0,95	0,3	0,37	0,62	0,2	0,51
11	0,95	0,3	0,37	0,62	0,2	0,51	0,82
12	0,3	0,37	0,62	0,2	0,51	0,82	0,75
13	0,37	0,62	0,2	0,51	0,82	0,75	0,33
14	0,62	0,2	0,51	0,82	0,75	0,33	0,19
15	0,2	0,51	0,82	0,75	0,33	0,19	0,42
16	0,51	0,82	0,75	0,33	0,19	0,42	0,72
17	0,82	0,75	0,33	0,19	0,42	0,72	0,78
18	0,75	0,33	0,19	0,42	0,72	0,78	0,86
19	0,33	0,19	0,42	0,72	0,78	0,86	0,49
20	0,19	0,42	0,72	0,78	0,86	0,49	
21	0,42	0,72	0,78	0,86	0,49		
22	0,72	0,78	0,86	0,49			
23	0,78	0,86	0,49				
24	0,86	0,49					
25	0,49						

Korelogram a hodnoty testových statistik:

	1 r_i	2 $n-i$	3 T_0	4 kvantil	5 rozhodnutí
1	0,235	24	1,1838	1,960	nezamítáme
2	-0,215	23	-1,0067	1,960	nezamítáme
3	-0,157	22	-0,7104	1,960	nezamítáme
4	0,119	21	0,5236	1,960	nezamítáme
5	0,171	20	0,7383	1,960	nezamítáme
6	0,310	19	1,3432	1,960	nezamítáme