

STATIONAARISET AIKASARJAT, 10 OP. 13.9.–14.12.2012. Kirjallisuus: James Hamiltonin *Time Series Analysis*, luvut 1–5 ja Terence Millsin *The Econometric Modelling of Financial Time Series*, luku 2. Luennoi: yliopistonlehtori Pekka Pere.

Stationaarisen ARMA(p,q)-mallin asteiden (p ja q) määrittely aineistosta:

- AR(p): ACF äärettömän pitkä ja vaimenee vähitellen. PACF katkeaa viipeen p jälkeen.
- MA(q): ACF katkeaa viipeen q jälkeen. PACF äärettömän pitkä ja vaimenee vähitellen.
- ARMA(p,q): Sekä ACF että PACF äärettömän pitkiä ja vaimenevat vähitellen.