

Задание № 6

Дана выборка курса биржевой стоимости акции некоторого предприятия за 12 месяцев.

1. Найти коэффициенты автокорреляции со смещением на 1,2,3 и 4 месяца.

2. Проверить найденные коэффициенты автокорреляции на значимость с доверительной вероятностью $p = 0,95$.

3. Построить коррелограмму.

4. Построить аддитивную (или мультипликативную) модель временного ряда.

Таблица 34.

Вариант	Стоимость акции по месяцам (руб.)												
1.	52,7	52,1	53,4	57,3	56,1	56,2	61,3	60,9	60,5	65,4	65,6	65,6	
2.	79	78,2	78,6	83,5	81	82,3	87,1	86,3	85,5	91,4	90,6	90,7	
3.	74,4	73,2	74,3	79,9	78,7	79,7	84,1	84,3	85,4	89,3	89,6	91	
4.	107	105	106	111	112	113	117	116	117	122	121	122	
5.	84,1	82,6	83,8	87,5	87,3	88,1	93	92,3	93,6	98,4	97,2	97,1	
6.	112	111	112	117	117	117	122	121	123	126	127	127	
7.	32,8	30,3	30,8	35,7	34,1	34,2	37,5	35,8	35,7	39,1	38,8	37,3	
8.	46,7	46,1	45,7	49,7	47,4	47,8	52	50,1	49,8	54,6	51,9	52,3	
9.	13,3	12,5	12,7	17,2	15,9	16,1	20,5	19,2	19,9	23,9	22,8	23,5	
10.	35,1	33	33,9	38,6	36,3	38	41,9	40	40,3	44,8	43,8	45,2	
11.	19,2	18	18,9	24,4	23,2	23,1	27,9	28,8	28,2	34,8	33,2	33,3	
12.	48,2	48,4	50,1	53,8	52,8	54,4	59,4	58,1	58,5	64,5	63,4	64,3	
13.	27	25,4	25,6	31	28,9	28,2	34	32,2	32,3	36,9	34,3	33,6	
14.	44,8	41,9	42,8	46,8	44,7	44,7	48,4	47,7	48,3	52,7	49,7	50,8	
15.	22	20,4	21,6	25,6	22,9	24,3	27,3	26,7	26,7	30,9	28,9	28,9	
16.	37,4	35,9	35,4	40,4	38,3	38,6	42,6	40,3	40,3	45,1	43,2	42,2	
17.	53,4	52,8	52	57,3	54,9	54,9	60,4	59,9	60,4	63,6	63,2	63,3	
18.	73,9	73,2	72,8	78	77,4	77,6	81,4	80,8	80,8	85,2	83,4	85,5	
19.	73,2	72,8	73,4	79,6	77,9	78,4	84,1	82,5	84	89,9	88,6	88	
20.	104	103	104	108	108	110	114	115	114	119	119	120	
21.	82,1	82,2	82	85,9	83,1	83,2	88,7	87,4	87,3	90,5	89,7	90	
22.	98,1	97,1	96,8	103	101	101	104	103	102	108	105	105	
23.	33,7	31,6	32,6	37,4	37,3	37,5	42,9	42,1	41,3	47,7	45,8	46,1	
24.	61,3	59	60,4	64,7	63,2	65,3	69,2	68,8	69,3	73,9	72,1	73,4	
25.	53,5	52,7	53,6	58,8	58,7	60,5	65,5	63,8	66	70,8	70	70,9	
26.	88,3	86,8	89,2	94	93,7	93,4	99,5	99,4	99,1	105	105	105	
27.	23,2	21,6	23,3	26,8	27	25,5	31,8	30,4	29,6	34,1	33,1	33,8	
28.	46,1	45,5	46,4	49,9	49,2	50,7	53,8	52,8	52,9	57,9	57,8	57,3	
29.	74,3	74,1	75,4	80,8	78,7	81,4	85,4	86,2	85,9	92	90,9	93,1	
30.	110	109	111	116	115	116	121	121	123	129	127	128	