

Модель временного ряда одномерная (Time-series one-dimensional model)

Модель временного ряда называется одномерной, если она предполагает, что значение каждого члена ряда рассматривается как взвешенная сумма некоторого числа значений предшествующих членов этого же временного ряда. Если значение временного ряда зависит также и от значений других временных рядов, то модель временного ряда является многомерной.

Одна из причин использования одномерных временных моделей заключается в том, что они могут быть особенно полезны, когда невозможно найти объясняющие факторы, измеряемые с той же частотой, что и исследуемые переменные. Например, если анализируются ежедневные доходы от биржевых операций, то в качестве объясняющих переменных могли бы выступать некоторые макроэкономические величины, которые измеряются не чаще, чем раз в месяц.