

opozoril, da kaže končno število vzorcev iz dveh poljubnih časovnih vrst z izrazitima avtokorelacijskima funkcijama skoraj gotovo močno križno korelacijo, zato križna korelacija, ki se sicer pogosto uporablja kot test pravilnosti izbire neke časovne vrste kot funkcije v modelu, v ta namen ni primerna. Če pa ima opazovani pojav opazen periodičen značaj (tako da je npr. $x(t-p) \approx x(t)$), lahko za eno izmed funkcij v modelu (17) vzamemo funkcijo $f_i(t) = x(t-p)$. Takšni modeli so znani kot avtoregresijski modeli. Ti modeli so zanimivi predvsem zato, ker omogočajo napovedovanje brez eksplicitno definiranih modelskih funkcij, kar pa se izkaže kot poseje ugodno takrat, ko pojavi ne kažejo vidne regularnosti in bi iz časovne vrste težko izbrali ustrezne funkcije.

V teh primerih je zakonitost pojava zajeta v koeficientih avtoregresijskega modela in v zgodovini pojava, in običajno ni izražena eksplicitno. Zato pri avtoregresijskih modelih ni enostavno ugotoviti, kako sprememba koeficientov vpliva na napoved. To pa otežuje tako interpretacijo napovedi kot možnost, da po opravljeni analizi napovedi skušamo z vnašanjem novih predpostavk spremeniti napoved.