

Двете грешки съвпадат асимптотично. При малки извадки обаче тестовата характеристика на Дюфур и Рой ще дава сериозни отклонения.

Поради тази причина тук възприемам друга дефиниция на ранговия коефициент на автокорелация от порядък k , а именно:

$$rr_k^* = \frac{\sum_{t=1}^{n-k} (R_t' - \bar{R})(R_t'' - \bar{R})}{\sum_{t=1}^{n-k} (R_t' - \bar{R})^2} = \frac{\sum_{t=1}^{n-k} (R_t' - \bar{R})(R_t'' - \bar{R})}{\sum_{t=1}^{n-k} (R_t'' - \bar{R})^2}, \quad (10)$$

където:

$$\sum_{t=1}^{n-k} (R_t' - \bar{R})^2 = \sum_{t=1}^{n-k} (R_t'' - \bar{R})^2 = \frac{(n-k)^3 - (n-k)}{12} \quad (11)$$

е девиацията на ранговете от 1 до $(n-k)$;

$$\bar{R} = \frac{1}{n-k} \sum_{t=1}^{n-k} R_t' = \frac{1}{n-k} \sum_{t=1}^{n-k} R_t'' = \frac{n-k+1}{2} \quad (12)$$

е средният ранг;

R_t' и R_t'' са съответно ранговете на първите $(n-k)$ и на последните $(n-k)$ остатъчни елемента.

При тази дефиниция, ранговете на първите и на последните $(n-k)$ остатъци са от 1 до $(n-k)$ и техните средни съвпадат. Лесно може да се покаже, че математическото очакване на автокорелационния коефициент е нула.

Възможните пермутации на редицата от рангове от 1 до $(n-k)$ са:

$$P_n = (n-k)!, \quad (13)$$

като всяка възможна реализация е равновероятна:

$$P(R_1, R_2, R_3, \dots, R_{n-k}) = \frac{1}{(n-k)!}, \quad (14)$$

където $R_1, R_2, R_3, \dots, R_{n-k}$ са пермутациите на числата от 1 до $(n-k)$.