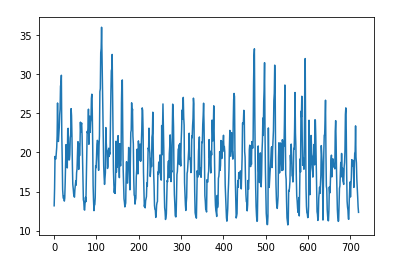
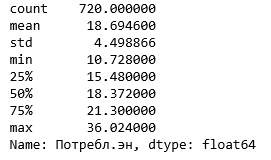
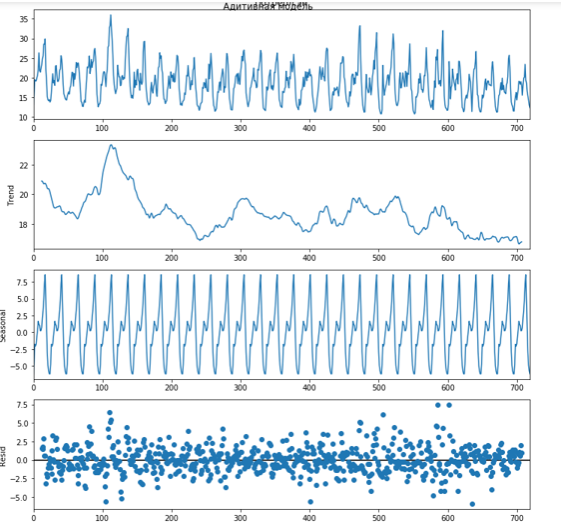
Временной ряд:



Статистики

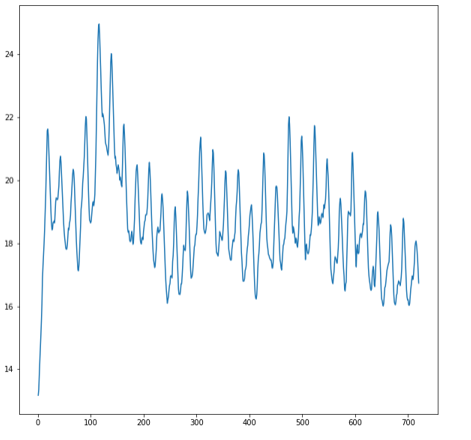


Декомпозиция (Аддитивная)

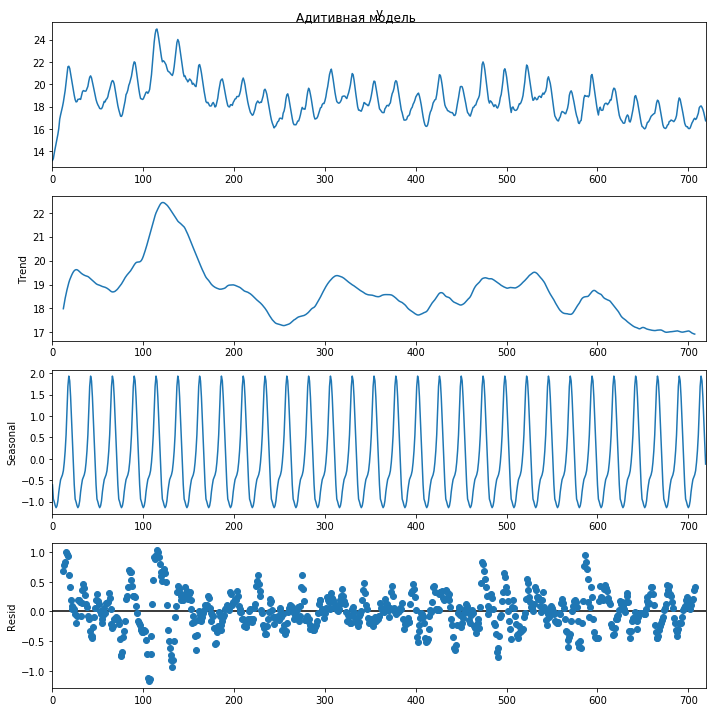


Применим к ряду экспоненциальную скользящую среднюю и сделаем декомпозицию:

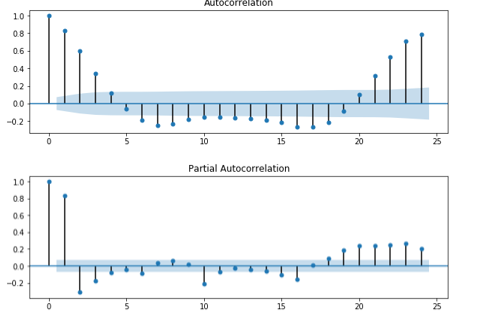
Временной ряд со скользящей средней:



Декомпозиция:



Автокорреляция (для определения сезонности):

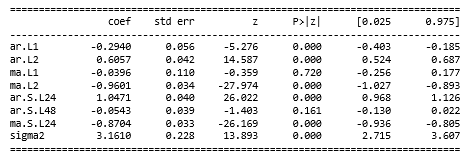


Найдем интегрированную модель авторегрессии скользящего среднего:

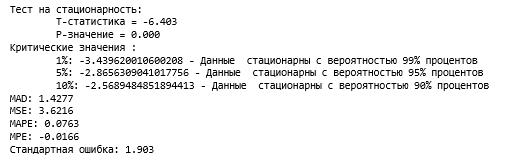
Лучшая модель



Параметры модели

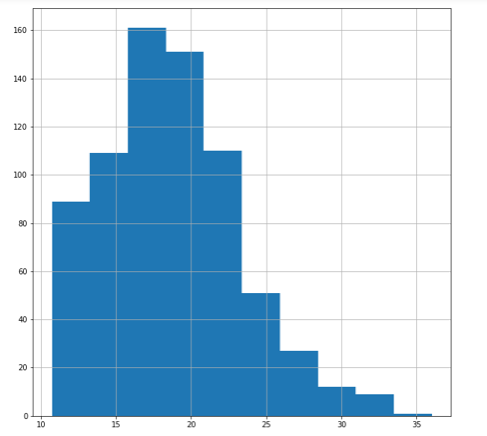


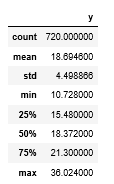
Точность модели



Метод Монте-Карло

Рассмотрим основные статистики и гистограмму исследуемого ряда:





Распределение похоже на треугольное, распределим случайным образом 1000 треугольных распределений (за основу возьмем статистики исследуемого ряда);



Получим наиболее вероятные значения(из 1000 распределений) и построим гистограмму:

