

Прогнозирование временных рядов

Разделение данных на тренировочную и тестовую выборку для временных рядов (без перетасовки)

```
In from sklearn.model_selection import train_test_split
    train, test = train_test_split(data, shuffle=False, test_size=0.2)
```

Создание календарных признаков

```
In # признак, в котором хранится год как число
    data['year'] = data.index.year

    # признак, в котором хранится день недели как число
    data['dayofweek'] = data.index.dayofweek
```

Формирование отступающих признаков

```
In data['lag_1'] = data['target'].shift(1)
    data['lag_2'] = data['target'].shift(2)
    data['lag_3'] = data['target'].shift(3)
```

Добавление признака скользящего среднего

```
In data['rolling_mean'] = data['target'].rolling(5).mean()
```

Словарь

Промежуток времени в будущем, на который строится прогноз, называется **горизонтом прогнозирования** (англ. *horizon forecast*).

Задача **прогнозирования временного ряда** состоит в построении модели, которая по историческим данным предскажет будущие значения временного ряда.