

Моделирование временных рядов

Семинар 2

Стратегии прогнозирования

Борис Демешев, Матвей Зехов

1 Подход к моделированию

2 Стратегии прогнозирования

На текущий момент мы знакомы только с простейшими моделями сглаживания и сведением задачи прогнозирования к табличной форме. Последняя наиболее удобна для иллюстрации различных стратегий прогнозирования, так как любой из рассмотренных подходов можно реализовать в табличном подходе. Для специализированных моделей временных рядов стратегия обычно продиктована строением самой модели. По мере нашего экскурса мы будем отмечать, какая стратегия применима в конкретном случае.

Допустим, мы успешно преобразовали в табличный вид. Он должен выглядеть примерно так:

t	y_t	y_{t-1}	y_{t-2}	y_{t-3}	x_{t-1}
3	3	2	1	0	10
4	4	3	2	1	15
5	5	4	3	2	20
6	6	5	4	3	12
7	7	6	5	4	17
8	8	7	6	5	30