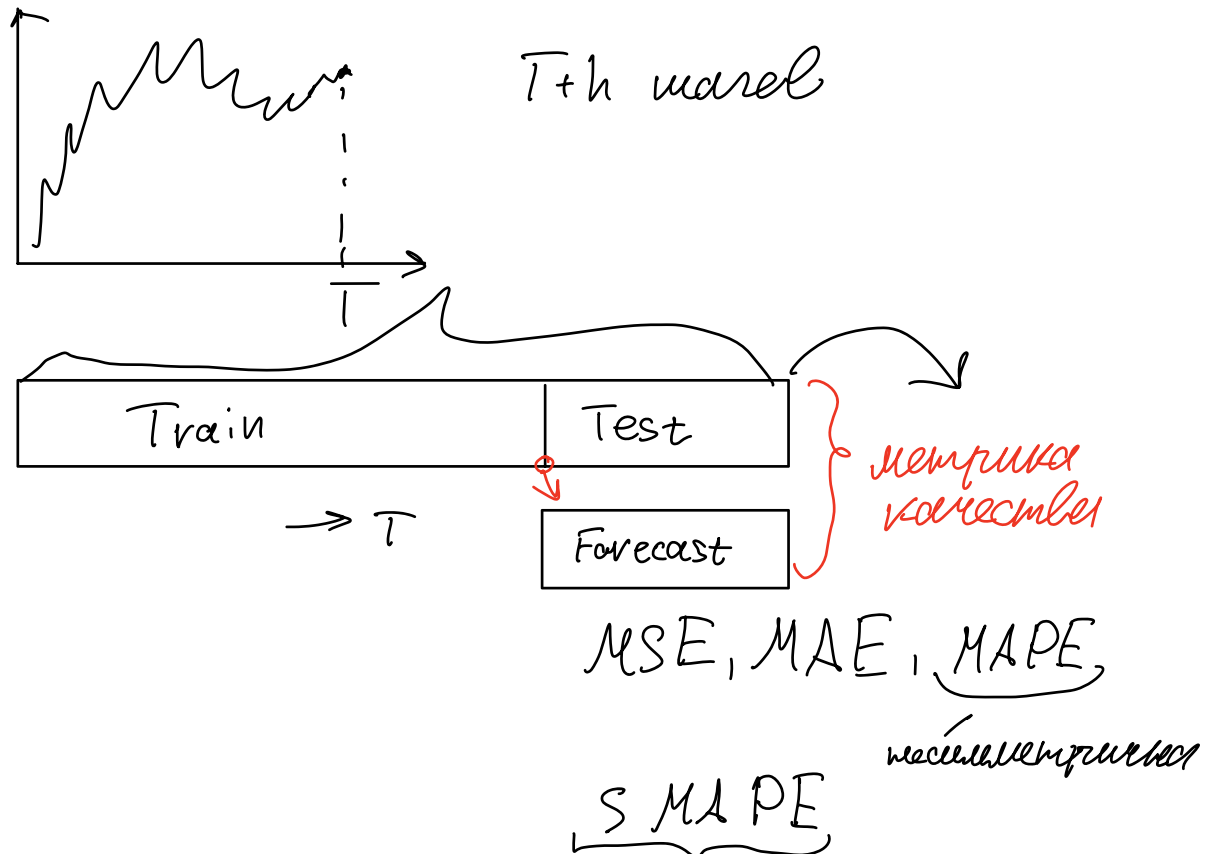


Метрики качества



1) Оценить модель на тренинге

1) Сравнить качество in-sample (AIC, BIC)

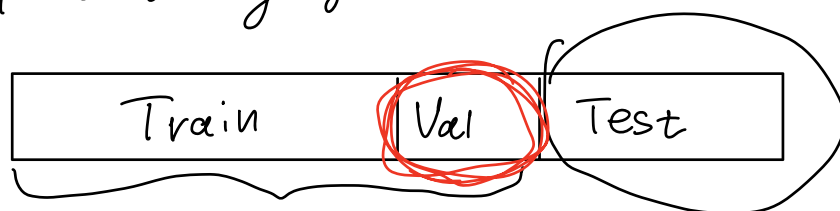
$$AIC = \underbrace{2K}_{\text{количество параметров}} - \underbrace{2 \ln(\hat{L})}_{\rightarrow \text{MSE на тренинге}}$$

2) Сравнить качество на тесте

1) (Оптимальная выборка)

Подходит для простых моделей без гиперпараметров)

2) Кросс-валидация

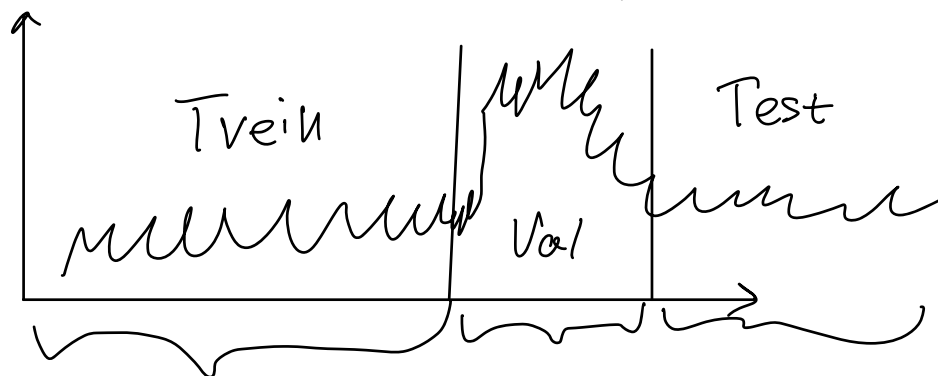


1) Гиперпараметры (в ETS - компоненты) (T, S, E)

Для каждого набора параметров:

- 1) Обучиваем на тренине
- 2) Считаем ошибку на валидации
- 3) Выбираем лучшую модель по миним. ошибке
- 4) Прогнозируем все время

2) Нестационарная структура данных



В М.О.:

T_r	T_r	V_{ai}
T_r	V_{ai}	T_r
V_{ai}	T_r	T_r

B Time Series:

$$T = 100 / k \rightarrow 100$$

1) Expanding window

TV	TV	Val	X	X
Tr	Tr	Tr	Val	X
Tr	Tr	Tr	Tr	Val

\xrightarrow{t} 20

leave-one-out CV
 прогнозируя
 значение на
 Val

2) Sliding window

TV	TV	Val	X	X
	Tr	Tr	Val	X
		Tr	Tr	Val

~~~~~  
 ~~~~~

