

Series de T tiempo Multivariadas con RNN basado en LSTM

Hay que tener en mente que hay algunos “Cons” con el uso de LSTM para series de tiempo multivariadas

La mejor recomendación es probar SARIMA o el mismo FB Prophet antes de recurrir a las LSTM

**Como todas las redes neutrales,
el modelo es esencialmente una
caja negra, difícil de interpretar!**

**Si se decide usar una red neuronal
LSTM, afortunadamente solo es
necesario hacer dos cambios
principales al modelo que ya hemos
visto**

Series de Tiempo Multivariadas

Cambios requeridos en las LSTM

- Cambiar la forma “shape” de los datos de entrada a la capa LSTM para reflejar la bi-dimensionalidad
- La capa “Densa” final debe tener tantas unidades (neuronas) como variables “features” hayan

Exploraremos estos cambios en una copia del Notebook que ya hicimos para una Serie de Tiempo Uni-variable