

Прогнозирование методами машинного обучения

Заполнение пропусков

Что будет тестовым множеством?

MAPE

Кросс-валидация при прогнозировании

Проблемы с трендом у деревьев регрессии,
а значит у Random Forest и у XGBoost

Лекарство:

Взятие разностей (DS)

удаление тренда, который определяется отдельной моделью (TS)

Если прогнозировать на 1 наблюдение вперед, происходит накопление ошибок при прогнозировании на 10 наблюдений.

Если сезонность мультипликативная, легче прогнозировать логарифм ряда

Дополнительные предикторы.

Могут помочь, но их значения в будущем тоже придется прогнозировать.