

Hoja informativa: Pronóstico de series temporales

Práctica

```
# división de datos en conjuntos de entrenamiento y prueba para series temporales (sin barajar)
from sklearn.model_selection import train_test_split
train, test = train_test_split(data, shuffle=False, test_size=0.2)
```

```
# creación de funciones de calendario
# esta característica contiene años como valores numéricos
data['year'] = data.index.year

# esta característica contiene días de la semana como valores numéricos
data['dayofweek'] = data.index.dayofweek
```

```
# formación de características de desfase

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

```
# agregar la característica de media móvil

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

Teoría

El objetivo del **pronóstico de series temporales** es desarrollar un modelo que prediga los valores futuros de una serie temporal con base en datos anteriores.

El periodo en el futuro para el que se prepara el pronóstico se conoce como **horizonte de pronóstico**.