

Comprehensive Benchmark Results with Neural Networks

Estimator	Mean MAE	Std MAE	Mean Time (s)	Success Rate
RandomForest	0.0349	0.0278	1.888	1.00
GradientBoosting	0.0354	0.0318	0.022	1.00
R/S	0.0489	0.0365	0.381	1.00
SVR	0.0556	0.0249	0.021	1.00
NN_gru	0.2000	0.1001	0.032	1.00
NN_lstm	0.2000	0.1003	0.031	1.00
NN_transformer	0.2000	0.1007	0.710	1.00
NN_convolutional	0.2004	0.1101	0.034	1.00
Whittle	0.2500	0.1658	0.000	1.00
NN_feedforward	0.2864	0.2061	0.066	1.00
GPH	0.3166	0.2924	0.032	1.00
NN_resnet	0.3237	0.2133	0.066	1.00
Periodogram	0.3390	0.2854	0.002	1.00
DFA	0.4084	0.1488	0.019	1.00
Higuchi	0.4349	0.1909	0.013	1.00
DMA	0.4624	0.1981	0.001	1.00