

Nezávislé premenné

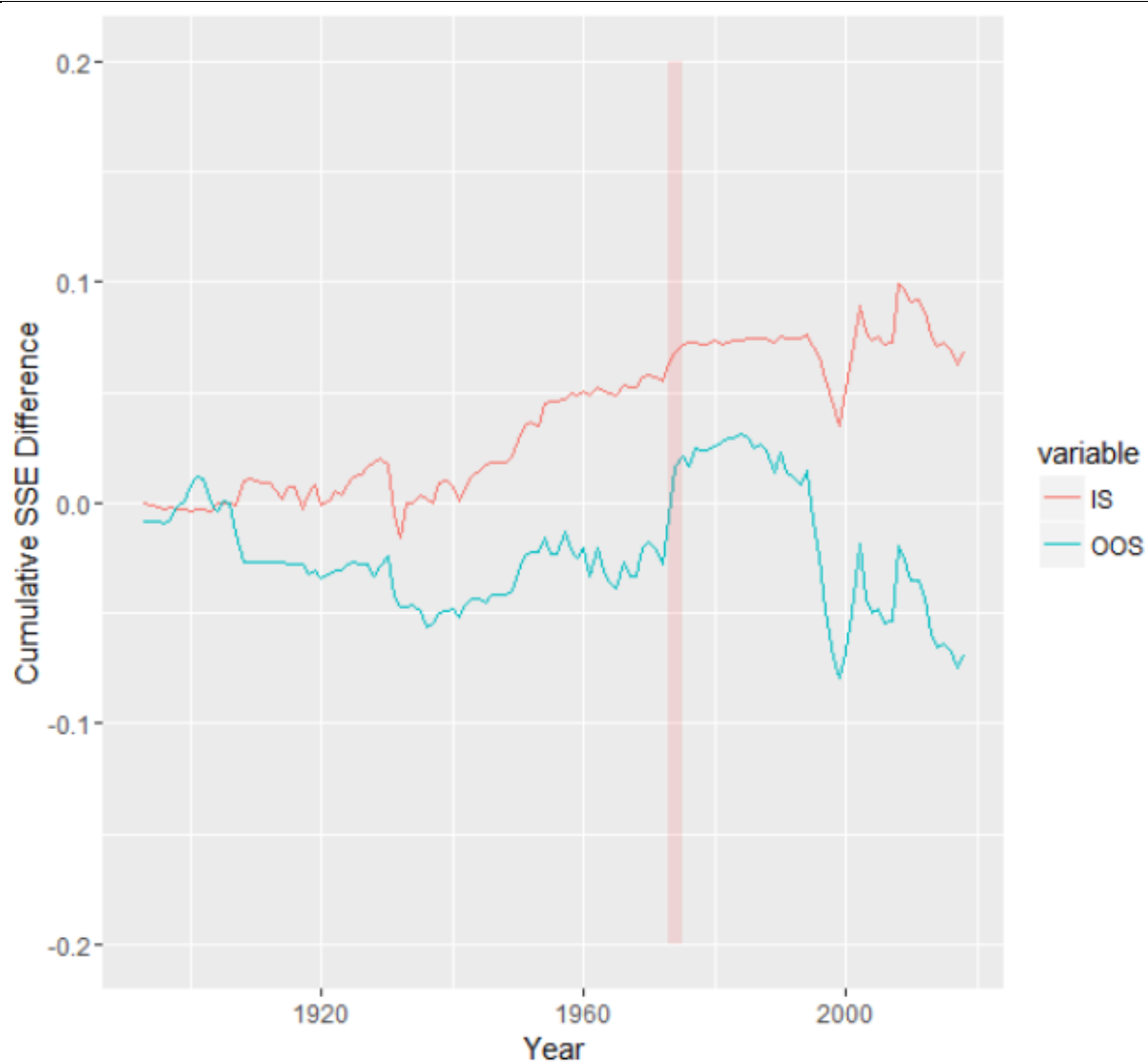
“dp” – dividend-price ratio

“ep” – earnings-price ratio

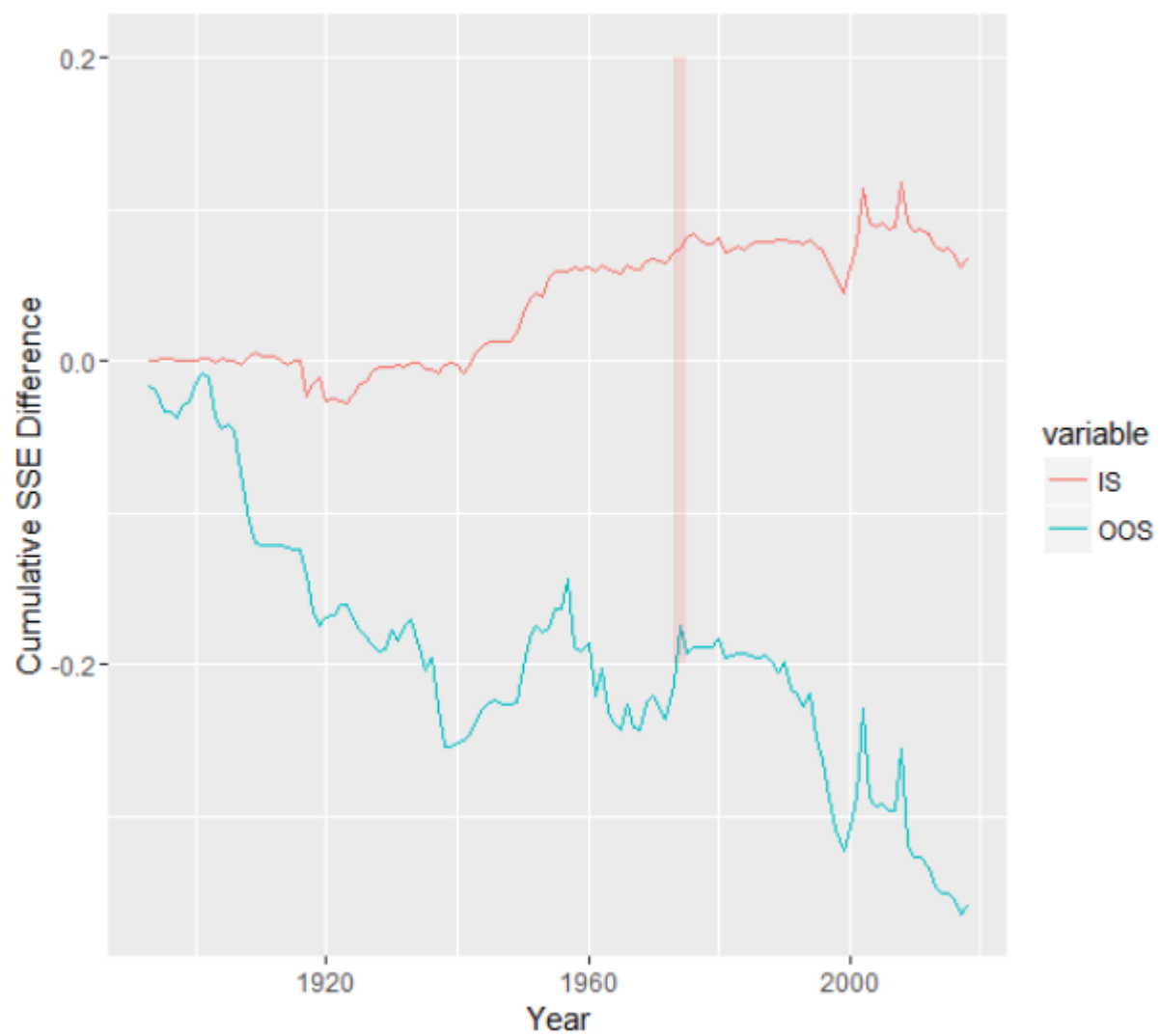
“dy” – dividend yield-price ratio

Závislá premenná

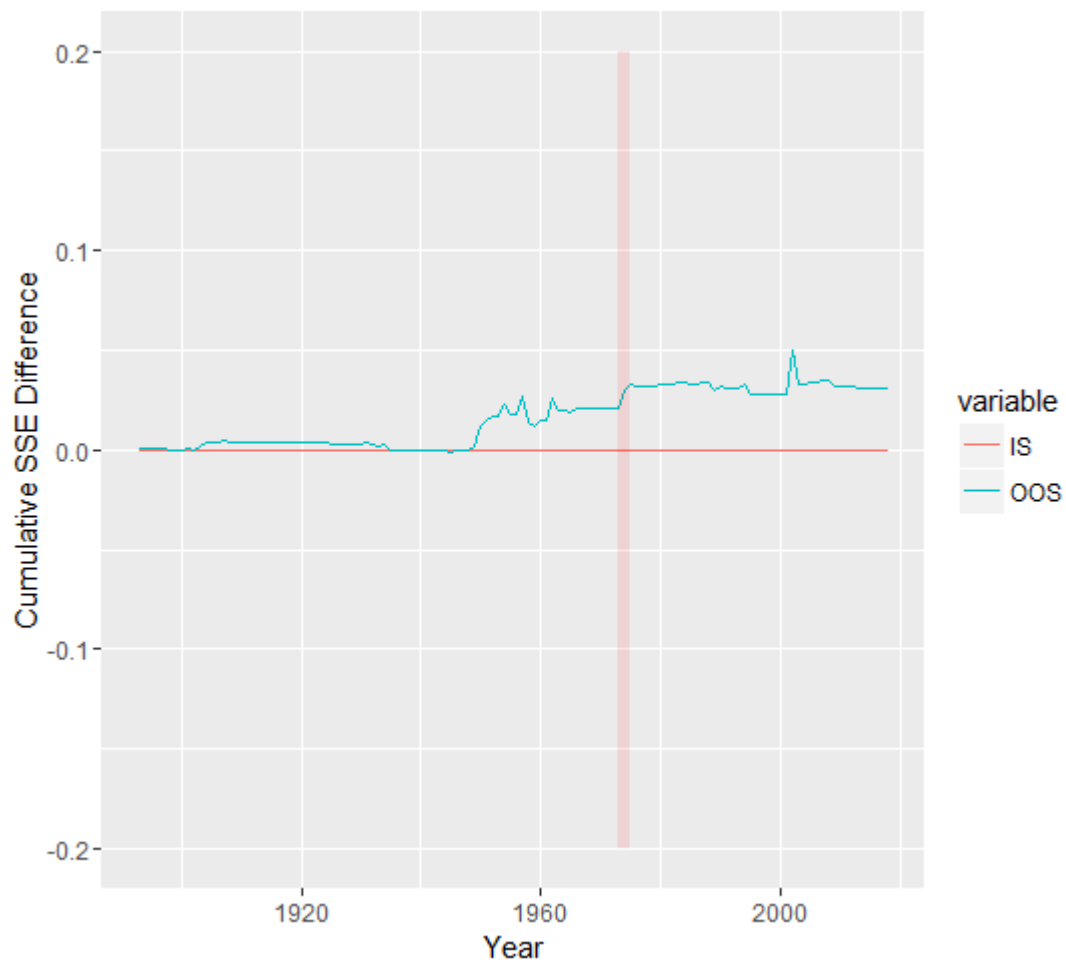
“rp_div” – log equity premium



Graf: LinReg Model s jednou premnnou – “dp” – dividend to price



Graf: LinReg Model s 3 premnnými – “dp”, “dy”, “ep”.

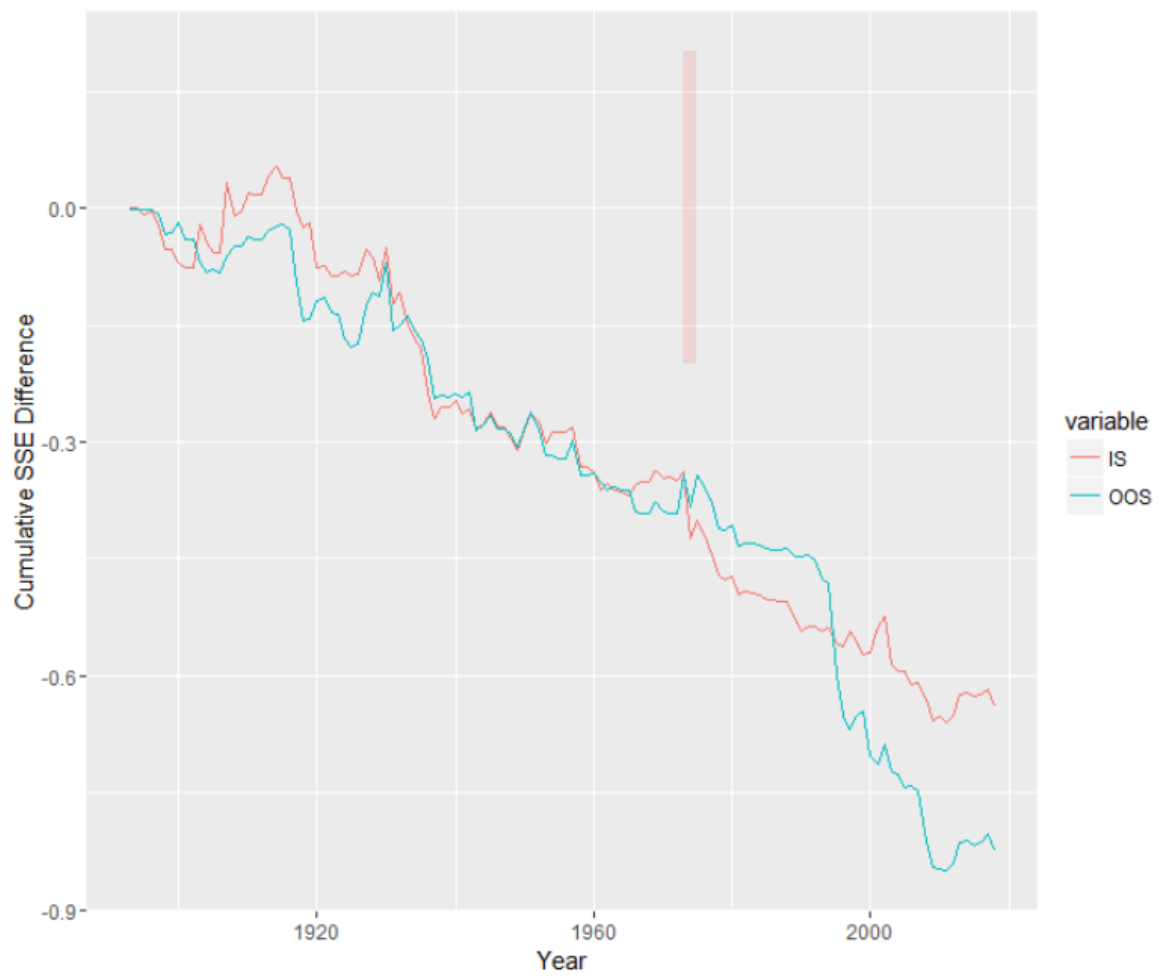


Graf: Lasso Model s 3 premnými – “dp”, “dy”, “ep”.

IS je “flat” lebo model uprednostnil 0, kedy ostatné parametre považoval za nadbytočné ako výsledkom cross-validation.

OOS je niekde “flat” to znamená, že uprednostnil 0.

S použitím `set.seed(123)`



Graf: Random Forest s 3 premennými – “dp”, “dy”, “ep”.
S použitím `set.seed(123)`
Pretože RF nie je vhodný na predikciu “trendujúcich” dátach?