Análisis de los residuos en los pronósticos

Los residuos en un pronóstico son la diferencia entre el valor observado en la serie de tiempo y el ajuste del pronóstico que se haya aplicado, los residuos se definen como

Los residuos deben cumplir los sig. supuestos

1. Los no están correlacionados
2. Tienen media cero

Propiedades de los residuos

1. Tienen varianza constante
2. Se distribuyen normal

Para evaluar los residuos en las series de tiempo se consideran 2 tipos de residuos

1. Con la misma escala
2. Con escala diferente

Las medidas que se utilizan para evaluar residuos con la escala son dos :

1. La media del error absoluto promedio(|)=MAE
2. Raíz del error cuadrático medio

De estas dos medidas el más utilizado es el MAE

Ses ->??? α=0.9-> MAE=0, α=0.3-> MAE≠0

α=0.3