

Тема 4. Оцінка якості прогнозу

4.4. Оцінка точності прогнозованої моделі та прогнозів.

Самостійна робота 4.2. Параметричні методи аналізу точності прогнозів

1. Провести аналіз точності прогнозів, отриманих при виконанні Завдання 2.1 використовуючи параметричні методи, а саме:

1.1) абсолютні показники помилки прогнозу: *(помилки (похибки) прогнозу e_j ; абсолютні помилки (похибки) прогнозу Δ_j ; середню абсолютну похибку прогнозу – MAE; суми квадратів помилки SSE; середній квадрат помилки (похибки) – MSE; середнє квадратичне відхилення (RMSE);*

1.2) відносні помилки прогнозу: *відносні помилка прогнозу ϵ_j ; середня абсолютна похибка у відсотках або відсоткова помилка MAPE; корінь з середньоквадратичної похибки у відсотках RMSPE; середня відсоткова помилка (похибка) прогнозу MPE;*

1.3) коефіцієнт невідповідності Тейла;

1.4) порівнянням окремих значень досліджуваної змінної з її середнім значенням: *абсолютне відхилення від середньої AD_j ; середнє абсолютне відхилення MAD.*

2. За допомогою отриманих показників точності прогнозів, розрахованих в п. 1 зробити порівняльний аналіз точності прогнозів, зроблених при виконанні завдання 2.1.