



图 378

3.4.8.2 ARIMA

图标:

描述: ARIMA 模型全称为自回归移动平均模型(Autoregressive Integrated Moving Average Model, 简记 ARIMA), 其中 ARIMA (p, d, q) 称为差分自回归移动平均模型, AR 是自回归, p 为自回归项; MA 为移动平均, q 为移动平均项数, d 为时间序列成为平稳时所做的差分次数。

字段属性

时序列: 请选择数值型数据, 如图 379 所示。

时序列 ?

图 379

参数设置

是否构建季节性 ARIMA 模型: 默认否。

P: 自回归阶数

D: 差分阶数

Q: 移动平均阶数

P(季节性): 季节性自回归阶数

D(季节性): 季节性移动平均阶数

Q(季节性): 季节性差分阶数

时序周期: 一般情况下季节性周期数据为 4, 月度周期数据为 12。

输出

表结果: 表结果包含预测值、残差、残差的平方。

报告: 系数表、模型检验图、预测图、残差及残差平方图。

示例

下面对某数据构造 ARIMA 模型。

- 勾选时序列, 如图 380 所示。
- 设置相应参数, 如图 381、图 382 所示。
- 运行成功后, 选择查看数据, 如图 383 所示。
- 运行成功后, 选择查看报告, 如图 384 所示。

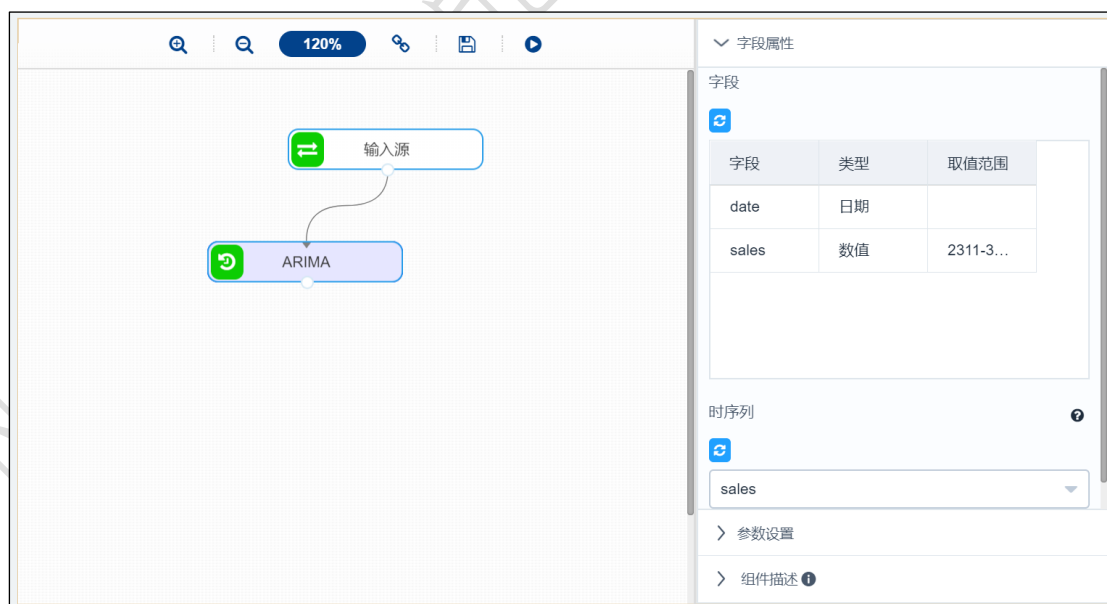


图 380

参数设置

是否构建季节性ARIMA模型

否

* p

1

* d

0

* q

0

图 381

P(季节性)

D(季节性)

Q(季节性)

时序周期

图 382

预览数据			
sales	predict	at	at2
51	0	51	2601
2618	47.92111853824536	2570.0788814617545	6605305.456935703
2608	2459.9507516299286	148.04924837007138	21918.579942943084
2652	2450.554453877331	201.44554612266893	40580.30805266034
3442	2491.898163988759	950.1018360112412	902693.4987919314
3393	3234.205686443932	158.79431355606812	25215.63401774288
3137	3188.163827456206	-51.163827456206036	2617.7372399684227
3744	2947.6186049897196	796.3813950102804	634223.3263185202

共 201 条 25 条/页 < 1 2 3 4 5 6 ... 9 > 前往 1 页

图 383



图 384

3.4.8.3 指数平滑

图标:  指数平滑

描述: 指数平滑法是平滑法的一种, 常用于趋势分析和预测, 利用修匀技术, 削弱短期随机波动对序列的影响, 使序列平滑化。

字段属性

序列: 仅支持数值型数据。