

Глубина прогноза (Forecast depth)

Синонимы: Глубина погружения

Loginom: Скользящее окно (обработчик).

Глубина прогноза — это ретроспективный временной интервал, выраженный в единицах временной шкалы, в которой измерена прогнозируемая величина (днях, месяцах, кварталах и т.д.), на основе наблюдений которого делается прогноз. Например, если мы хотим построить прогноз на VI квартал, используя данные за I, II и III кварталы, то глубина составит 3, а горизонт прогнозирования будет равен 1.

Вообще, чем больше исходных данных используется для построения модели прогноза, тем более точным ожидается результат прогнозирования. Иными словами, можно предположить, что чем больше ретроспективных наблюдений мы будем применять для построения предсказывающей модели, тем она будет точнее.

Но при выборе глубины прогноза это не совсем так, поскольку слишком «старые» данные могли утратить свою актуальность и перестали отражать современные тенденции и закономерности исследуемого процесса. Поэтому глубину прогноза следует выбирать в пределах периода актуальности.