

Метод скользящего окна (Windowing method)

Синонимы: Метод кадрирования

Разделы: [Алгоритмы](#)

LogInom: [Скользящее окно \(обработчик\)](#).

Метод скользящего окна — алгоритм трансформации, позволяющий сформировать из членов временного ряда набор данных, который может служить обучающим множеством для построения модели прогнозирования.

Под окном в данном случае понимается временной интервал, содержащий набор значений, которые используются для формирования обучающего примера. В процессе работы алгоритма окно смещается по временной последовательности на единицу наблюдения, и каждое положение окна образует один пример.

Например, если еженедельно поступают данные о продажах в течение 50 недель и установлено окно в 5 недель, то в первом примере используются данные с 1 по 5 неделю, а целевым значением будут данные за 6-ю неделю. Во втором случае используются данные со 2 по 6 неделю, а в качестве целевого значения берутся данные за 7-ю и т.д.

Временной ряд	1	2	3	4	5	6	7	8	9	...	n
1 окно	x1	x2	x3	x4	x5	y1					
2 окно		x1	x2	x3	x4	x5	y1				
3 окно			x1	x2	x3	x4	x5	y1			
...											

Если требуется построить прогноз не на одну единицу наблюдения, а на несколько, то в качестве целевых выбирается соответствующее число значений, которое называется горизонтом прогноза. Количество наблюдений ряда, которые берутся в качестве входных значений называется глубиной прогноза.