# PRIMA PARTE: SE ed SET su una serie sintetica

Z = 1:100 + rnorm(100)

ts.plot(Z)

SE.Z = HoltWinters(Z,beta=FALSE ,gamma=FALSE)

plot(SE.Z)

SET.Z = HoltWinters(Z, gamma=FALSE)

plot(SET.Z)

par(mfrow=c(1,2))

plot(SE.Z)

plot(SET.Z)

Qui si vedono i pregi di SET.

par(mfrow=c(2,1))

plot(SE.Z)

plot(SET.Z)

par(mfrow=c(1,1))

Eserc: ragionare su Z = 1:100 + 5\*rnorm(100)

# SECONDA PARTE: SE ed SET sulla serie auto

X = scan("clipboard")

11849 1316 4712 800 5097 3270 5390 2135 5962 5795

9271 6864 4247 7961 7191 4970 5012 2929 7363 4907

4700 8219 8674 8263 4294 6097 9115 8924 12561 8626

9559 1706 7405 8057 6463 7595 6702 11052 8422 10019

9594 6443 12052 3535 7962 12876 10614 6469 9396 8421

10895 16583 13724 15362 10740 6999 8168 11241 12206 9600

13865 11190 11306 9760 16678 17245 17059 6331 17635 25429

24124 8025 16168 23902 15618 24579 23023 16311 18848 8986

19745 21513 17378 17839 20271 13917 22520 30279 33373 27728

29400 12759 32293 39832 21975 13304 21511 24382 27790 19053

30140 18024 39378 9351 29202 30944 30984 51181 25809 23035

33939 26385 37051 27823 26570 27587 23434 40944 30355 37954

21883 28773 37127 41490 40786 48097 42233 31002 44818 52006

44235 47597 41311 29891 65657 46764 56831 45358 42840 22724

54484 60902 59253 30692 54913 49463 61164 53140 53932 61780

76395 25181 52878 59362 36356 22600 69768 62622 48934 43957

46525 47652 68435 23165 65990 60518 38106 21206

accessori.auto = ts(X, frequency=12, start=c(1995,1))

Y = scan("clipboard")

70.6 121.8 165.1 159.9 210.3 188.8 191.1 41.9 141.7 96.4

67.7 41.1 90.7 113.7 137.1 113.0 117.7 122.6 112.0 19.6

85.7 74.0 71.3 48.3 64.7 101.1 117.9 113.0 139.8 123.8

128.7 27.1 89.9 85.7 72.6 48.0 71.1 94.9 112.1 119.2

123.5 117.0 129.0 23.8 111.9 96.8 82.1 58.2 85.8 110.2

142.2 133.2 142.8 140.9 131.2 28.7 101.5 82.1 69.7 56.1

76.7 86.3 115.8 132.1 147.3 139.9 131.2 41.0 105.5 86.6

86.3 51.3 80.3 120.5 172.4 133.0 169.1 168.3 146.8 38.0

105.1 97.6 88.1 63.7 96.9 120.6 154.7 137.3 166.5 158.9

150.1 35.9 119.0 103.6 89.6 60.6 92.1 118.1 140.5 157.8

157.6 153.3 151.3 17.2 106.7 94.1 70.9 57.9 61.6 83.1

113.0 109.2 121.5 122.4 123.2 18.3 103.1 68.2 57.1 33.1

59.3 100.1 115.2 116.0 126.0 109.2 105.1 10.0 75.0

vendite.moto = ts(Y, frequency=12, start=c(2000,1))

ts.plot(vendite.moto)

# Prima SE:

SE = HoltWinters(X,beta=FALSE ,gamma=FALSE)

plot(SE)

plot(SE, predict(SE,12))

molto conservativo:

plot(HoltWinters(x = X, alpha = 0.01, beta = FALSE, gamma = FALSE))

molto innovativo:

plot(HoltWinters(x = X, alpha = 0.99, beta = FALSE, gamma = FALSE))

# Ora SET:

SET = HoltWinters(X, gamma=FALSE)

plot(SET)

par(mfrow=c(1,2))

plot(SE)

plot(SET)

Il vantaggio non è evidente. C’è più flessibilità, sicuramente i residui saranno più piccoli, quindi il fit è migliore, ma corrisponderà ad una miglior predizione?

Rispetto alla serie sintetica, meno rumorosa, il problema è che le fluttuazioni della nostra X sono così grandi che SET le interpreta come cambi di trend.

par(mfrow=c(1,1))

plot(SET, predict(SET,12))

Il risultato è disastroso. I continui cambi di trend producono predizioni senza senso.

Per cercare di ovviare a questo inconveniente, si potrebbe provare a decidere i parametri a mano, in modo conservativo (per stabilizzare il trend).

a = 0.01; b = 0.01

Cons = HoltWinters(X, alpha = a, beta = b, gamma = FALSE)

plot(Cons, predict(Cons,12))

a = 0.5; b = 0.01

Cons = HoltWinters(x = X, alpha = a, beta = b, gamma = FALSE)

plot(Cons, predict(Cons,12))

a = 0.01; b = 0.5

Cons = HoltWinters(x = X, alpha = a, beta = b, gamma = FALSE)

plot(Cons, predict(Cons,12))

Non c’è niente da fare. Si potrebbe anche leggere il valore ottimale dei parametri e fare piccole variazioni attorno ad essi.

# Variante.

# Se il nostro scopo è di catturare il trend per poi proseguirlo, un’idea migliore è trovare il trend con stl e proseguire quello. C’è da scegliere k:

trend = stl(accessori.auto,7)$time.series[,2]

plot(trend)

trend = stl(accessori.auto,15)$time.series[,2]

plot(trend)

trend = stl(accessori.auto,3)$time.series[,2]

plot(trend)

Quest’ultimo corrisponde maggiormente alla nostra intuizione, quindi lo usiamo.

SET.stl = HoltWinters(trend, gamma=FALSE)

plot(SET.stl, predict(SET.stl,12))

# TERZA PARTE: Holt-Winters

HW = HoltWinters(X)

plot(HW)

non funziona. Il vero Holt-Winters ha bisogno della scelta del periodo, ovvero della dichiarazione della frequency.

HW = HoltWinters(accessori.auto)

plot(HW)

par(mfrow=c(1,2))

plot(SET)

plot(HW)

ricalca maggiormente la serie storica, presumibilmente i residui sono minori (si potrebbe controllare), mostra segni di periodicità. Vediamo la previsione:

par(mfrow=c(1,1))

plot(HW, predict(HW,24))

Il risultato è sorprendentemente buono. Ha catturato il profilo periodico recente e lo ha riprodotto, all’altezza giusta.

HW.moto = HoltWinters(vendite.moto)

plot(HW.moto, predict(HW.moto,24))

Fenomenale. Ha catturato simultaneamente sia il lieve trend calante sia la periodicità.