

Cvičení 9 – Předpověď s diskrétním modelem

Příklad 1: Model $f(y_t|y_{t-1}, u_t, \Theta)$

$y_t \in \{0, 1, 2\}$ – dopravní prostředek (tramvaj, autobus, auto)

$u_t \in \{1, 2, 3, 4, 5, 6, 7\}$ – den v týdnu

- Dimenze modelu 21×3
- Nuly v datech
- Chyba predikce

Viz programy pro cvičení 9

Zadání pro samostatnou práci

- 1 Použijte data pro příklad 1 pro redukci dimenze modelu:

$y_t \in \{1, 2\}$ – dopravní prostředek (MHD, auto)

$u_t \in \{1, 2\}$ – den v týdnu (všední den, víkend)

Například:

```
// kde jsou všední dny
```

```
a=find(u==1 | u==2 | u==3 | u==4 | u==5);
```

```
u(a)=1;
```

```
a=find(u==6 | u==7); // kde jsou víkendy
```

```
u(a)=2;
```

- 2 Použijte zpracovaná data pro odhad a vícekrokovou předpověď s modelem $f(y_t | y_{t-1}, u_t, \Theta)$ a porovnejte chybu predikce

Dimenze statistiky?