

Kinga Głabińska

Kiedy pracujemy z szeregami czasowymi, istnienie obserwacji odstających może przysporzyć nam wiele kłopotów. Przede wszystkim dlatego, że mogą nam zaburzać model. Outliery występujące na końcu szeregu czasowego mogą powodować np. zawyżone predykcje. Dlatego tak ważne jest zarówno ich rozpoznanie jak i odpowiednie przypisanie im nowej wartości. Okazuje się, że może być to jednak sporym wyzwaniem, ponieważ klasyczne metody detekcji outlierów nie sprawdzają się, gdy mamy zależność od czasu. W trakcie prezentacji, omówimy potencjalne problemy jakie mogą się pojawić przy detekcji oraz imputacji obserwacji odstających w szeregach czasowych i spróbujemy je rozwiązać.