

Нейронные сети для обнаружения аномалий в многомерных временных рядах

Проводится сравнение различных нейросетевых архитектур для задачи обнаружения аномалий.

Для каждого ряда подсчитан модуль разности d .

$$d_t = |y_t - x_t|$$

Дополнительно значения d были преобразованы с помощью

экспоненциального

сглаживания:

$$s_t = \alpha d_t + (1 - \alpha)s_{t-1}$$

