

Восстановление прогноза, сделанного в метрическом вероятностном пространстве, в исходное пространство (временных рядов)

Максим Михайлович Дивильковский

Московский физико-технический институт

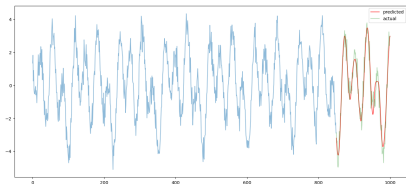
Курс: Автоматизация научных исследований
(практика, В. В. Стрижов)/Группа 125

Эксперт: В. В. Стрижов

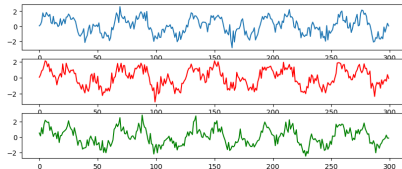
Консультант: К. Д. Яковлев

2024

Доклад с одним слайдом



Предсказание методом LSTM



Ряды высокой попарной корреляции

- ▶ X — линейное пространство временных рядов. $X \cong \mathbb{R}^T$
- ▶ $\rho(x, y), x, y \in X$ — расстояния в X
- ▶ $X \rightarrow \Sigma_T$ — матрица попарных расстояний
- ▶ $\Sigma_T \rightarrow \Sigma_{T+1}$ — прогноз в следующий момент времени
- ▶ $\Sigma_{T+1} \rightarrow \hat{X}$ — **восстановление прогноза**