Решаем систему

Метод численного интегрирования работает на нерегулярной сетке времени с узлами , при этом , где – шаг интегрирования в точке времени и позволяет рассчитать значения и по известным значениям и при условии, что и гладкие.

Вводим векторы Нордсика для шага

Прогноз строится с помощью матрицы Паскаля

Векторы и рассчитывается по выражениям

|  |  |
| --- | --- |
|  |  |
|  |  |

Переносим в правую часть – избавляемся от массы умножений