

Machine Learning

Données séquentielles - Premières approches

- Calcul des différences du premier ou second ordre.
- Modèles autoregressifs à moyenne mobile (ARMA)
- Modèles de Markov

$$x_t = g(t) + \phi_t$$

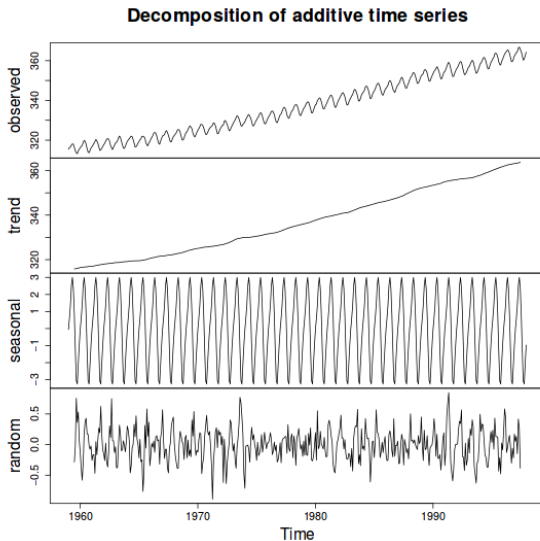
où

$g(t)$ est déterministe (tendance globale du signal)

$\phi(t)$ est un bruit stochastique

Les modèles statistiques “classiques” vont alors essayer de décomposer $g(t)$ en plusieurs fonctions dépendant de t ou bien de fonction récurrentes (comme dans ARMA)

Données séquentielles - Premières approches



Si ces méthodes vous intéressent :

http://www.ulb.ac.be/di/map/gbonte/ftp/time_ser.pdf

Un notebook (en anglais) est aussi disponible sur le sujet dans le dossier codelab