

## Neural SDE для нахождения моментов разладки временных рядов

*Tuesday, 21 May 2024 12:25 (12 minutes)*

Данная статья предлагает развить математический аппарат, на котором строится модель Neural SDE. В ней рассмотрено, как вычисление фазовых траекторий стохастических дифференциальных уравнений обеспечивает качественный прогноз аномалий во временном ряду. Таким образом, это предоставит как возможность эффективнее бороться с шумами, так и, в частности, полезный инструмент для упреждения появления так называемых черных лебедей - резких перемен поведения временных рядов, как случайных процессов. Подобного рода аномалии способны нарушить корректную работу Neural SDE в виду высокой корреляции элементов анализируемой выборки между собой.

**Primary author:** ПАПАЙ, Иван

**Co-authors:** Prof. СТРИЖОВ, Вадим (МФТИ); Mr ВЛАДИМИРОВ, Эдуард (МФТИ)

**Presenter:** ПАПАЙ, Иван

**Session Classification:** 21 Computer & Data Science

**Track Classification:** Computer & Data Science