

**Отчетная конференция научного трека инновационного практикума
ФПМИ 2024**

Contribution ID: 2

Type: **not specified**

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 дляупреждения 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