

КАК ЗАГЛЯНУТЬ ЗА ГОРИЗОНТ ПРОГНОЗА В НЕЛИНЕЙНЫХ СИСТЕМАХ

Громов В.А.

Национальный исследовательский университет "Высшая школа экономики" (НИУ
ВШЭ)

Концепция непрогнозируемых точек позволила сформулировать новую постановку задачи прогнозирования на много шагов вперед: в рамках этой постановки предполагается, что алгоритм обладает способностью различать прогнозируемые и непрогнозируемые точки и давать прогноз в прогнозируемых. Было установлено, что для хаотических временных рядов с ростом числа шагов вперед, на которое необходимо получить прогноз, число непрогнозируемых точек растёт, при этом ошибка в прогнозируемых точках не превышает некоторого порогового значения. Предлагаемый подход к решению задачи многошагового прогнозирования в такой постановке позволили получить прогнозы в некоторых точках за горизонтом прогнозирования.