

タイトル

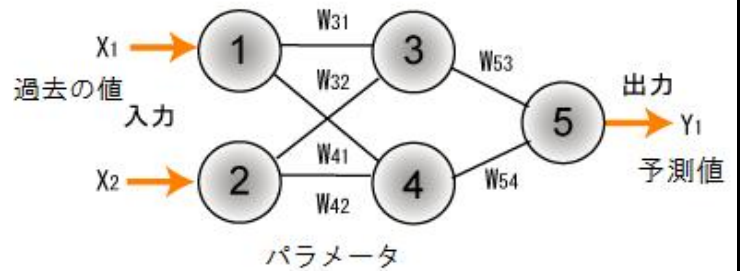
時系列に関する幅を持たせた予測について

Time Series Forecasting with width

概要

過去の時系列データを基に、将来の変動を予測する。その際、単純に値を予測するのではなく、外れ値を除いた上で取り得る値の最大値と最小値を求め、幅を持たせて予測する。具体的には、線形的な予測手段であるARIMAモデルと非線形的なNeuralNetworkを組み合わせたHybrid法、および最適化の考え方をを用いた。その結果、高精度に予測することに成功した。

ニューラルネットワークによる予測のイメージ図

URL <http://amech.amp.i.kyoto-u.ac.jp/index.php>

産業界への展開例・適用分野

太陽の黒点や為替など、メカニズムのはっきりしない時系列データを取り扱う分野

研究者

	氏名	専攻	研究室	役職 (学年)
展示担当者	伊藤 康輔	数理工学	物理統計学 研究室	修士2年