

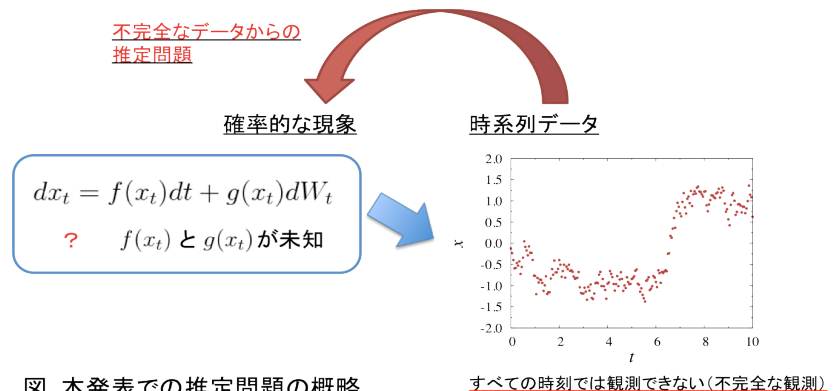
タイトル

不完全な時系列データからモデルを高速に推定する

Rapid computation for estimation problems with incomplete time-series data

概要

何の事前知識もなく時系列データだけが与えられた時に、データの元となったモデルを推定する問題を考える。この時、モデルが非線形性を持っているとすると、一般には推定に多くの計算時間を必要とする。また、すべての時刻でデータを得ることはできず、データが不完全である状況も実際には生じうる。この不完全なデータに対して、局所線形化と呼ばれる近似法などを用いた推定アルゴリズムを提案する。



URL

http://www-adsys.sys.i.kyoto-u.ac.jp/ohkubo/index_j.html

産業界への展開例・適用分野

金融工学等の社会科学関係からシステム生物学関係を含めて、様々な分野においてメカニズムのはっきりとしていない時系列データを扱う際に適用可能

	氏名	専攻	研究室	役職(学年)
展示担当者	大久保 潤	システム科学	適応システム論 分野	講師