

сумме наименьших квадратов зависит от экспоненциальной функции времени с основанием степени меньше 1. Скорость забывания определяется задаваемым извне параметром – постоянной сглаживания.

УДК 621.311

## Развитие метода адаптивного сглаживания для применения в задачах прогнозирования графиков

Домников С. В., Згаевская Г. В.

Белорусский национальный технический университет

Метод адаптивного сглаживания был бы применим для прогнозирования набора значений членов ряда на любом из заданных интервалов периодичности (т. е. прогнозирования графиков), если бы для каждого члена удалось каким – либо образом получить хотя бы искаженную шумом оценку предшествующего члена, которая зависела бы не только от прогноза последнего методом адаптивного сглаживания, но и от косвенной информации, позволяющей более точно учесть характер изменения периодической составляющей ряда (назовем эту оценку псевдореализацией).

Такая возможность обычно имеет место, поскольку каждая последовательность значений ряда, соответствующих одинаковым фазам периодов (назовем ее рядом фазового сечения), изменяется плавно и может быть хорошо описана простой формой уравнения регрессии, для достоверного определения параметров которого не потребуется большой длины ряда. Целесообразно принимать показательную форму регрессии членов ряда фазового сечения. Это вытекает из априорного допущения о постоянстве относительного изменения членов ряда для данной фазы интервала периодичности.

Как и для основной модели адаптивного сглаживания, параметры регрессионных моделей для рядов фазовых сечений должны по мере поступления новой информации о зарегистрированных членах рядов пересчитываться рекуррентным образом.

Это требование всегда можно выполнить, если в качестве хранимых параметров моделей использовать не непосредственные значения коэффициентов уравнению, а некоторые промежуточные параметры, которые поддаются рекуррентному пересчету и по которым можно однозначно определить значение коэффициентов [1].

Литература

1. Гурский, С. К., Домников, С. В. Адаптивный метод прогнозирования временных рядов, содержащих периодические составляющие с априорно известным периодом, для задач планирования и управления в ЭЭС. – Изв. Вузov СССР. Сер. энерг., 1979, № 12.