

短文

稀疏贝叶斯及其在时间序列预测中的应用

[张旭东](#) [陈锋](#) [高隼](#) [方廷健](#)

(中国科技大学自动化系 合肥 230027)

Abstract 阐述了稀疏贝叶斯方法在时间序列预测中应用的理论基础,将稀疏贝叶斯方法应用于Logistic 方程产生的混沌时间序列和发动机油滑数据的预测,并与支持向量机(SVM)和RBF神经网络时间序列预测进行了比较.实验结果表明,稀疏贝叶斯方法不仅具有SVM的性能,而且比SVM使用更少的核函数,取得了较好的预测效果.

Keywords [稀疏贝叶斯](#) [支持向量机](#) [非线性预测](#) [RBF 神经网络](#)

收稿日期 2005-3-15 修回日期 2005-5-10

通讯作者 张旭东

DOI 分类号 TP391