**Вероятностные смеси цепей Маркова с частичными связями**

**Аннотация**

*Харин Ю. С., Сергеев А. И.*

Дискретные временные ряды широко применяются в различных сферах современного общества. Универсальной моделью дискретного временного ряда является цепь Маркова высокого порядка s. Цепь Маркова – вероятностная модель, используемая для представления зависимости между последовательными наблюдениями случайной величины.

Использование цепей Маркова высокого порядка в чистом виде не применяется из-за экспоненциального роста числа параметров при увеличении s. В докладе рассматривается вероятностная смесь цепей Маркова с частичными связями, обобщающая МТД – модель Рафтери, которая задаёт так называемый «малопараметрический» вид матрицы P вероятностей переходов. Представлены результаты компьютерных экспериментов.