

Аннотация дипломной работы

Тема: СТАТИСТИЧЕСКАЯ КЛАССИФИКАЦИЯ СТАЦИОНАРНЫХ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ В ПРОСТРАНСТВЕ КОВАРИАЦИОННЫХ ФУНКЦИЙ.

Горбачевич Дмитрий Александрович.

Научный руководитель: Жук Евгений Евгеньевич.

Кафедра ММАД.

27 страниц, 3 иллюстрации, 8 источников, 2 таблицы.

Ключевые слова: ВРЕМЕННОЙ РЯД, КЛАССИФИКАЦИЯ, КОВАРИАЦИОННАЯ ФУНКЦИЯ, СТАЦИОНАРНЫЙ ВРЕМЕННОЙ РЯД, БАЙЕССОВСКОЕ РЕШАЮЩЕЕ ПРАВИЛО, МЕТОД L-СРЕДНИХ, СПЕКТРАЛЬНАЯ ПЛОТНОСТЬ.

Цель работы: разработать и программно реализовать алгоритмы статистической классификации стационарных временных рядов. Протестировать разработанные алгоритмы с использованием реальных данных.

Основные результаты работы:

- 1) Разработаны алгоритмы и осуществлена программная реализация классификации стационарных временных рядов;
- 2) Разработан алгоритм классификации стационарных временных рядов в пространстве оценок коэффициентов авторегрессии;
- 3) Разработано и программно реализовано байессовское решающее правило в пространстве оценок коэффициентов ковариации;
- 4) Разработан и программно реализован метод L-средних в пространстве оценок ковариационных функций.
- 5) Произведено аналитическое сравнение риска для трех методов. Произведен эксперимент на реальных данных.