

Аннотация дипломной работы

Тема: «Статистический анализ слабозависимых гауссовских временных рядов при наличии цензурирования»

Войлоков Виктор Сергеевич

Научный руководитель: Бодягин И. А.

Кафедра математического моделирования и анализа данных.

Дипломная работа, 52 с., 6 рис., 3 табл., 3 приложения, 2 главы, 17 источников.

Ключевые слова: ВРЕМЕННЫЕ РЯДЫ, МОДЕЛЬ АВТОРЕГРЕССИИ СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО, МЕТОД МАКСИМАЛЬНОГО ПРАВДОПОДОБИЯ, ИНТЕРВАЛЬНОЕ ЦЕНЗУРИРОВАНИЕ, СЛУЧАЙНЫЕ ВЕКТОРА.

Цель работы – построить статистические оценки параметров слабозависимых авторегрессионных временных рядов и временных рядов скользящего среднего при наличии интервального цензурирования.

В дипломной работе были предложены методы оценивания параметров моделей авторегрессии, скользящего среднего при наличии интервального в предположении о слабой зависимости элементов, основанные на методе максимального правдоподобия.