

Аннотация дипломной работы

Тема Статистическое прогнозирование лонгитюдных авторегрессионных временных рядов с цензурированием

ФИО студента Сологуб Анастасия Сегреевна

Научный руководитель Бодягин Игорь Александрович

Кафедра (специальность, специализация) Специальность прикладная математика, кафедра математического моделирования и анализа данных

Объем дипломной работы, количество рисунков, количество использованных источников литературы, структура дипломной работы 32 с., 4 рис., 11 источников, 3 главы.

Ключевые слова Временной ряд, векторная авторегрессия, лонгитюдная авторегрессионная модель, прогнозирование, интервальное цензурирование.

Цель работы Построить оптимальную прогнозирующую статистику для временного ряда, заданного лонгитюдной векторной авторегрессионной моделью при наличии интервального цензурирования.

Описание работы студента В дипломной работе получены следующие основные результаты:

1. Построены оптимальные прогнозирующие статистики для лонгитюдного векторного авторегрессионного временного ряда с экзогенными переменными как при наличии цензурирования, так и при наличии дополнительных сведений о прогнозируемом значении.
2. Для частных случаев модели лонгитюдного векторного авторегрессионного временного ряда с экзогенными переменными при наличии цензурирования оптимальная прогнозирующая статистика найдена в частном виде.
3. Проведены компьютерные эксперименты на модельных данных, которые показали значительное преимущество оптимальной прогнозирующей статистики по сравнению с альтернативными прогнозирующими статистиками, описываемыми в литературе.