

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ
БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ
Кафедра математического моделирования и анализа данных

Аннотация к дипломной работе
**«Отнесение реализаций авторегрессионных временных рядов к
заданным классам»**

Борисов Антон Владимирович

Научный руководитель – профессор кафедры ММАД Жук Е.Е.

АННОТАЦИЯ

Дипломная работа, 43 с., 5 рис., 5 таблиц, 15 источников.

СТАЦИОНАРНЫЙ ВРЕМЕННОЙ РЯД, СТАТИСТИЧЕСКАЯ КЛАССИФИКАЦИЯ, АВТОРЕГРЕССИОННЫЕ МОДЕЛИ, РЕШАЮЩЕЕ ПРАВИЛО, РАЗЛОЖЕНИЕ ВОЛЬДА, РИСК.

Объект исследования – решающее правило в пространстве коэффициентов авторегрессии.

Цель работы – исследовать эффективность решающего правила в контексте задачи отнесения авторегрессионных временных рядов к заданным классам.

За время работы:

- исследовано решающее правило, оценена его эффективность;
- выявлены возможности использования для классификации стационарных в широком смысле временных рядов;
- проведена экспериментальная проверка результатов на нескольких наборах данных;

Полученные результаты могут быть использованы для решения задачи классификации временных рядов, заданных авторегрессионными моделями.

ABSTRACT

Diploma thesis, 43 p., 5 pic., 5 tables, 15 sources.

STATIONARY TIME SERIES, STATISTICAL CLASSIFICATION, AUTOREGRESSIVE MODELS, DECISION RULE, RISK.

Object of research – a decision rule in the space of autoregressive coefficients.

Purpose of research – assess the effectiveness of the decision rule in the context of assigning the autoregressive time series to the given classes.

During the work:

- the decision rule and its effectiveness were studied;
- the possibility of usage for wide-sense stationary time series classification was researched;
- Experimental examination of the results was conducted on several datasets;

Provided results can be used for solving the classification problem of the time series given in the form of autoregressive models.