

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

Аннотация к дипломной работе
**«Статистическое соотнесение нестационарных временных рядов по
авторегрессионной составляющей»**

Аксютин Дмитрий Сергеевич

Научный руководитель – профессор кафедры ММАД Жук Е.Е.

2017

Аннотация

Дипломная работа, 39 с., рис. 29, источников 6.

Ключевые слова: ARMA, оценка параметров, МНК-оценка, стационарность, асимптотический риск, решающее правило.

Объектом исследования являются AR, ARMA временные ряды, реальные данные, моделированные данные.

Целью работы является рассмотрение, реализация и применение сформулированного решающего правила, вычисление асимптотического риска.

В результате исследования было реализовано решающее правило на языке программирования Java, вычислена вероятность неправильного соотнесения временных рядов.

Методы исследования статистический анализ.

Область применения – экономика, эконометрика, программирование.

Abstract

Graduate work, 39 p., images. 29, sources 6.

Key words: ARMA, estimation of parameters, OLS estimation, stationarity, asymptotic risk, decision rule.

The object of the research are AR, ARMA time series, real data, simulated data.

The aim of the research is the consider, implementation and application of the formulated decision rule, the calculation of asymptotic risk.

As a result of the research is a decision rule which was implemented in the Java programming language, the probability of incorrect correlation of time series was calculated.

Methods of research - statistical analysis.

The application area - economics, econometrics, programming.