

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра математического моделирования и анализа данных

Аннотация к магистерской диссертации

**СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ ПО НЕПОЛНЫМ ДАННЫМ С
ИСПОЛЬЗОВАНИЕМ ЯЗЫКА R**

Чибисов Олег Олегович

Научный руководитель — кандидат физико-математических наук,
доцент И. А. Бодягин

2017

РЕФЕРАТ

Магистерская диссертация, 41 с., 8 рис., 8 табл., 9 источников.

ВРЕМЕННОЙ РЯД, ЦЕНЗУРИРОВАНИЕ, ПРОПУСКИ, ОЦЕНКИ МАКСИМАЛЬНОГО ПРАВДОПОДОБИЯ, МЕТОД МОМЕНТОВ

Объект исследования – временные ряды при наличии пропусков.

Цель работы – анализ временных рядов при наличии пропусков, произвести статистическое оценивание параметров методом моментов при наличии пропусков, разработать программную реализацию.

Методы исследования – методы теории вероятности, численной алгебры и математической статистики.

Результатами является статистическая система оценивания параметров временных рядов при наличии пропусков.

Областью применения является статистический анализ данных.

ABSTRACT

The master's thesis, 41 pages, 8 figures., 8 t., 9 literature references.

TIME SERIES, CENSORED, OMISSIONS, MAXIMUM LIKELIHOOD ESTIMATION, METHOD OF MOMENTS

Research object – time series in the presence of gaps.

Purpose of the degree work – time series analysis in the presence of gaps, generate statistical parameter estimation method of moments in the presence of gaps, develop a software implementation.

Research methods – methods of probability theory, numerical algebra and mathematical statistics.

The results of the work is a statistical evaluation system time series of parameters in the presence of gaps.

The results can be applied and used in statistical analysis of data.