

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к магистерской диссертации

**«Эффективность и робастность последовательных решающих правил
в статистическом анализе данных»**

Хахомов Дмитрий Сергеевич

Научный руководитель – доктор физико-математических наук,
доцент Харин А.Ю.

Минск, 2020

Реферат

Магистерская диссертация, 51 страница, 50 рисунков, 11 источников
ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНЫЙ ТЕСТ, ИСКАЖЕНИЯ, ВЫБРОСЫ,
ВЕРОЯТНОСТИ ОШИБОК, СРЕДНЕЕ ЧИСЛО НАБЛЮДЕНИЙ,
РОБАСТНОСТЬ.

Объект исследования – статистические последовательные тесты при наличии искажений в наблюдениях.

Цель работы – модификация последовательных тестов и анализ эффективности с целью повышения робастности к искажениям.

Методы исследования – методы теории вероятностей, статистики и компьютерного моделирования.

Результат – модифицированные последовательные тесты и выявленные закономерности по анализу робастности к искажениям.

Область применения – анализ элементов рыночной экономики, финансовый менеджмент, прогнозирование.

Abstract

Master's thesis, 51 pages, 50 pictures, 11 references.

SEQUENTIAL TEST, DISTORTION, OUTLIERS, ERROR PROBABILITIES, AVERAGE NUMBER OF OBSERVATIONS, ROBUSTNESS.

Object of research – statistical sequential tests under distortions in observations.

Research goal – modification of sequential tests and analysis of efficiency in order to increase robustness w.r.t. distortions.

Research methods – methods of probability theory, statistics and computer modeling.

Result – modified sequential tests and revealed regularities in the analysis of robustness to distortions.

Application field – market economy researches, financial management, forecasting.