

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**Последовательный статистический анализ с адаптивным
прогнозированием завершения**

Капустин Максим Дмитриевич

Научный руководитель – доктор физ.-мат. наук, доцент Харин А.Ю.

Минск 2021

Реферат

Дипломная работа, 68 страницы, 18 таблиц, 28 рисунков, 8 источников, 1 приложение.

Ключевые слова: ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНЫЙ АНАЛИЗ, ПРОГНОЗИРОВАНИЕ, ГИПОТЕЗЫ, МЕТОД НАИМЕНЬШИХ КВАДРАТОВ.

Объект исследования – последовательный критерий отношения вероятностей.

Цель работы — исследование последовательного критерия отношения вероятностей с адаптивным прогнозированием завершения.

В ходе работы рассматривается тест Вальда для проверки как простых, так и сложных гипотез с двумя вариациями адаптивного прогнозирования завершения.

Результатом является подбор наиболее эффективного метода адаптивного прогнозирования.

Областью применения являются рынки ценных бумаг и область здравоохранения.

Abstract

Diploma work, 68 pages, 18 tables, 28 drawings, 8 sources, 1 annex.

Key words: SEQUENTIAL ANALYSIS, FORECASTING, HYPOTHESIS, LEAST SQUARES METHOD.

The object of the study is sequential probability ratio test.

The purpose of the work is consideration of sequential probability ratio test with adaptive end forecast.

In the course of the work, Wald test for simple and complex hypothesis is considered, as well as two methods for test end forecasting.

The result is the selection of the most effective adaptive forecasting method.

The area of application is the securities markets and the healthcare sector.