

Аннотация магистерской диссертации Нгуен Тхи Ай Хоа

Тема: Статистический анализ оценок спектральных плотностей стационарных случайных процессов

ФИО магистранта: Нгуен Тхи Ай Хоа.

Научный руководитель: Труш Николай Николаевич, профессор кафедры ТВиМС, доктор физ.-мат. наук.

Кафедра (специальность, специализация): ТВиМС (прикладная математика и информатика).

Магистерская диссертация, 43 с., 8 табл., 10 источников, 3 раздела.

Ключевые слова: ВЕЙВЛЕТНАЯ ОЦЕНКА, СПЕКТРАЛЬНАЯ ПЛОТНОСТЬ, АСИМПТОТИЧЕСКАЯ НЕСМЕЩЕННОСТЬ, СОСТОЯТЕЛЬНОСТЬ В СРЕДЕКВАДРАТИЧЕСКОМ СМЫСЛЕ, НОРМАЛЬНОЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЕ, СКОРОСТЬ СХОДИМОСТИ.

Цель работы – Цель магистерской диссертации состоит в развитии метода построения, а также статистического анализа вейвлетной оценки спектральной плотности стационарного случайного процесса.

Рассматриваются свойства математического ожидания, ковариации, дисперсии вейвлетной оценки спектральной плотности стационарного случайного процесса.

Statistical analysis of the spectral density of stationary random processes

Nguyen Thi Ai Hoa.

Supervisor: N.N. Trough.

Department (specialty, specialization): Probability theory and mathematical statistics (Applied Mathematics and Computer Science).

Master's thesis, 43 p., 8 sheet, 10 sources, 3 charts.

Key words: WAVELET ASSESSMENT, SPECTRAL DENSITY, ASYMPTOTICALLY UNBIASED, NORMAL DISTRIBUTION, RATE OF CONVERGENCE.

The purpose of the master's thesis is to develop a method of construction, as well as statistical analysis of the wavelet estimation of the spectral density of a stationary random process.

The properties of expectation, covariance, the variance of the wavelet spectral density estimate are considered.