**Догадова Татьяна Валерьевна Прогнозирование и идентификация динамических систем методами усеченного оценивания**

ОГЛАВЛЕНИЕ ДИССЕРТАЦИИ

кандидат наук Догадова Татьяна Валерьевна

Введение

1 Модели с дискретным временем. Усеченное последовательное

оценивание параметров динамических систем

1.1 Введение к главе

1.2 Постановка задачи. Модель общей регрессии

1.3 Оптимальное оценивание параметра динамики процесса А11(1)

1.3.1 Адаптивное усеченное последовательное оценивание параметра процесса АИ (1) с неизвестной дисперсией шума

1.3.2 Эффективность усеченной последовательной оценки

1.3.3 Имитационное моделирование усеченных последовательных оценок неизвестного параметра процесса АЯ(1)

1.3.4 Моделирование адаптивных прогнозов стоимости ценных бумаг

1.4 Оценивание авторегрессионного параметра динамики

процесса А1Ш1СН(1,1)

1.4.1 Имитационное моделирование оценок неизвестного

авторегрессионного параметра процесса АПА11СН(1,1)

1.5 Оценивание параметров двумерного процесса авторегрессии АЯ(2) специального вида

1.6 Оценивание авторегрессионных параметров процесса А11А11СН(2,2)

1.7 Оценивание авторегрессионного параметра процесса

А11А11СН(1л)

1.8 Оценивание среднего случайного авторегрессионного параметра процесса АПА11СН(1,1)

1.8.1 Случай известной дисперсии шумов

1.8.2 Случай неизвестной дисперсии шумов

1.8.3 Имитационное моделирование оценок среднего случайного авторегрессионного параметра процесса А1Ш1СН(1,1)

1.9 Выводы по главе

2 Модели с непрерывным временем

2.1 Введение к главе

2.2 Метод усеченного оценивания. Общий результат

2.3 Прогнозирование процесса Орнштейна-Уленбека

2.3.1 Усеченное оценивание параметра процесса Орнштейна-Уленбека

2.3.2 Адаптивное оптимальное прогнозирование процесса Орнштейна-Уленбека

2.3.3 Имитационное моделирование

2.4 Адаптивное прогнозирование негауссовского процесса Орнштейна-Уленбека

2.5 Прогнозирование негауссовского процесса Орнштейна-Уленбека по дискретным наблюдениям

2.6 Гарантированное оценивание параметра процесса Орнштейна-Уленбека по наблюдениям с аддитивным зависимым шумом

2.7 Прогнозирование многомерных диффузионных процессов

2.7.1 Оценивание параметров многомерных диффузионных процессов

2.7.2 Адаптивное оптимальное прогнозирование многомерных диффузионных процессов

2.8 Однопараметрическое дифференциальное уравнение с запаздыванием

2.8.1 Усеченное оценивание параметра однопараметрического дифференциального уравнения

с запаздыванием

2.8.2 Адаптивное прогнозирование процесса, удовлетворяющего однопараметрическому дифференциальному уравнению с запаздыванием

2.9 Выводы по главе

Заключение

Список литературы

Приложение А Акт о внедрении результатов диссертации в учебный

процесс НИ ТГУ