**Гель, Юлия Рэмовна.**

## Идентификация линейных моделей стационарных и слабо неустойчивых временных рядов : диссертация ... кандидата физико-математических наук : 01.01.09. - Санкт-Петербург, 1999. - 98 с. : ил.

## Оглавление диссертациикандидат физико-математических наук Гель, Юлия Рэмовна

Введение

1 Математические модели случайных временных рядов

1.1 Модель полезного сигнала и помехи в стандартной форме.

1.2 Модель наблюдаемого сигнала в форме вход-выход

1.3 Виды ARMA уравнений.

1.4 Аппроксимация Паде

2 Идентификация объектов, описываемых устойчивыми регрессионными уравнениями

2.1 Бесконечный вариант метода Юла-Уолкера. Сходимость усеченных оценок.

2.2 Численный пример.

3 Идентификация объектов, описываемых неустойчивыми авторегрессионными уравнениями

3.1 Метод эмпирического функционала.

3.2 Сходимость рекуррентных оценок метода наименьших квадратов.

3.3 Сходимость функционалов для слабо неустойчивого регрессионного уравнения.

3.4 Численный пример.

4 Оценивание дрейфующих параметров полезного сигнала, наблюдаемого на фоне белой помехи

4.1 Постановка задачи.

4.2 Отслеживание дрейфа авторегрессионных параметров в АЯМА-модели.