**Меленец, Юрий Витальевич.**
Анализ временных рядов с периодическими вероятностными характеристиками : диссертация ... кандидата физико-математических наук : 01.01.05. - Минск, 1984. - 128 с. : ил.

## Оглавление диссертациикандидат физико-математических наук Меленец, Юрий Витальевич

ВВЕДЕНИЕ.

ГЛАВА I. АНАЛИЗ БИНАРНЫХ СЛУЧАЙНЫХ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОСТЕЙ

С ПЕРИОДИЧЕСКИМИ ВЕРОЯТНОСТНЫМИ ХАРАКТЕРИСТИКАМИ

§ I.I. Математическая модель бинарной случайной последовательности с периодическими вероятностными характеристиками

§ 1.2. Оценивание элементов опорной последовательности при известном периоде Т.

§ 1.3. Оценивание периода и элементов опорной последовательности методом максимального правдоподобия

§ 1.4. Эффективность оценивания параметров последовательности методом максимального правдоподобия

§ 1.5. Оценивание периода корреляционно-экстремальным методом.

ГЛАВА 2. АНАЛИЗ S -ЗНАЧНЫХ ( S\* 2) СЛУЧАЙНЫХ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОСТЕЙ С ПЕРИОДИЧЕСКИМИ ВЕРОЯТНОСТНЫМИ

ХАРАКТЕРИСТИКАМИ.

§ 2.1. Математическая модель S -значной случайной последовательности с периодическими вероятностными характеристиками

§ 2.2. Оценивание вероятностей при известном периоде Т

§ 2.3. Оценивание периода последовательности методом максимального правдоподобия.

§ 2.4. Отношение функций .правдоподобия для кратных значений 'С

§ 2.5. Математическое ожидание и дисперсия логарифма функции правдоподобия. Эффективность оценивания периода Т

ГЛАВА 3. ПРЕДСТАВЛЕНИЕ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ С ПЕРИОДИЧЕСКИМИ ВЕРОЯТНОСТНЫМИ ХАРАКТЕРИСТИКАМИ УРАВНЕНИЯМИ АВТОРЕГРЕССИИ

§ 3.1. Введение и постановка задачи

§ 3.2. Представление ВРПЕХ уравнениями авторегрессии 2-го порядка

§ 3.3. Представление ВРПВХ уравнениями авторегрессии п.-ого (л9-2) порядка.

§ 3.4. Представление ВРПВХ уравнениями авторегрессии с полигармоническими помехами