

Семинар ИТПЗ РАН

Профсоюзная 84/32, здание ИКИ РАН, этаж 2(тех), АЗ, к.207.

Телефоны для справок: +7 (495) 333-3401/4556

18 февраля (четверг), 11:00

Юрий Николаевич Орлов (ИИМ РАН)

**Согласованный уровень стационарности временного ряда
и гистограммная оценка выборочной плотности
распределения**

Предложены непараметрические статистики для определения того, что можно было бы назвать характерным уровнем шума при анализе рядов данных. Одна из них – так называемый согласованный уровень стационарности ряда в той или иной норме (С, L1 и т.п.). Приводятся примеры практического применения разработанного аппарата для задачи оптимального разбиения гистограммы, а также для задачи идентификации разладки.