

Метод Монте-Карло SSA для многомерных временных рядов

Потешкин Егор Павлович, гр.20.Б04-мм

Санкт-Петербургский государственный университет
Прикладная математика и информатика
Вычислительная стохастика и статистические модели

Отчет по производственной практике (научно-исследовательская работа) (6 семестр)

Санкт-Петербург, 2023

MC-SSA для многомерных временных рядов

Метод Монте-Карло SSA для многомерных временных рядов

Потешкин Егор Павлович, гр.20.Б04-мм

Санкт-Петербургский государственный университет
Прикладная математика и информатика
Вычислительная стохастика и статистические модели

Отчет по производственной практике (научно-исследовательская работа) (6 семестр)

Санкт-Петербург, 2023

Научный руководитель к.ф.-м.н., доцент Голяндина Н.Э.,
кафедра статистического моделирования

$X^{(d)} = (x_1^{(d)}, x_2^{(d)}, \dots, x_{N_d}^{(d)})$ — временные ряды длины N_d .

$X = \{X^{(d)}\}_{d=1}^D$ — D -канальный временной ряд с длинами N_d .

Модель: $X = S + R$, где S — сигнал, а R — шум.

MC-SSA для многомерных временных рядов

└ Введение

Текст про введение