

Вопросы на экзамен

1. Разложения матриц: виды разложений и основные свойства
2. Задача наименьших квадратов (линейная и нелинейная)
3. ЕМ-алгоритм: постановка соответствующей задачи и метод решения
4. Методы нелинейной оптимизации
5. Эвристические методы оптимизации
6. Стохастические процессы, марковские цепи
7. Стохастические процессы, марковские цепи с непрерывным временем
8. Скрытые марковские модели, алгоритмы вывода
9. Стационарные временные ряды, стационарные процессы
10. Статистическое моделирование временных рядов, процессы AR, MA, ARMA
11. Фильтр Калмана
12. Алгоритмы поиска аномалий и резких изменений во временных рядах