

199(16) заседание Межпредметного семинара
состоится в среду **22 февраля 2012 г. в 18:35** в аудитории **202НК**

Практические задачи анализа нестационарных временных рядов

д.ф.-м.н. Орлов Юрий Николаевич
(ИПМ РАН; кафедра высшей математики МФТИ)

В докладе будет дан обзор проблем, возникающих при применении теории вероятностей к практическим задачам, связанным, в частности, с анализом фондового рынка и с обоснованием тех или иных прогнозных алгоритмов. Будут рассмотрены задачи определения оптимального объема выборки для построения прогнозных моделей и описаны варианты таких моделей.

Во многих случаях нестационарность ряда наблюдаемых величин обусловлена нерегулярной сменой режимов функционирования той «физической системы», которой порождены эти величины. Тем самым возникает задача о построении индикаторов смены режима, т.е. индикаторов разладки. В докладе будут даны некоторые примеры таких индикаторов, которые в определенных условиях могут трактоваться и как предикторы.

Тематика, связанная с нестационарными временными рядами, начиная с весеннего семестра 2012 г., будет развиваться на кафедре физико-технической информатики ФИВТ в содружестве с компанией «ИГ Норд-Капитал».

Литература

Орлов Ю.Н., Осминин К.П. Нестационарные временные ряды: методы прогнозирования с примерами анализа финансовых и сырьевых рынков. – М.: Книжный дом «ЛИБРОКОМ», 2011. – 384 с.



Темы ближайших заседаний:

- 29.02.2012. Семинар N200. "Функциональная механика и проблема необратимости" И.В. Волович ([МИАН](#))
(предварительно)
07.03.2012. "Лекция-концерт красота в науке и искусстве" М.А. Капустин ([каф.общ.физ](#)) (предварительно)
14.03.2012. "Финслерова геометрия" В.Г.Жотиков ([кафедра общей физики](#) МФТИ) (предварительно)
21.03.2012. "Углерод – элемент 'более равный', чем другие" В.В. Бражкин ([ИФВД РАН](#)) (предварительно)
28.03.2012. "Измерение цвета" В.С.Булыгин ([кафедра общей физики](#) МФТИ)