



БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

26 апреля – М.В. Болдин (МГУ им. М.В.Ломоносова)

2017 г.

Робастный знаковый тест для гипотезы о единичном корне авторегрессии

Наблюдения за $AR(1)$ авторегрессией содержат грубые ошибки (засорения). Распределение засорений неизвестно и произвольно. Проверяется гипотеза о единичном корне авторегрессии, т.е. гипотеза о том, что наблюдения порождаются случайным блужданием. В качестве альтернативы классическому тесту наименьших квадратов (в рассматриваемой ситуации он неприменим) предлагается специальный локально наиболее мощный знаковый тест. Установлена его локальная качественная робастность в терминах равностепенной непрерывности мощности.

**Семинар проводится по средам в аудитории 12-24 Главного Здания
Московского Государственного Университета им. М.В. Ломоносова
с 16:45 до 17:45**

Координатором семинара на весенний семестр 2017 года назначен
д. ф.-м. н. доцент Лебедев Алексей Викторович