



## БОЛЬШОЙ СЕМИНАР КАФЕДРЫ ТЕОРИИ ВЕРОЯТНОСТЕЙ

Руководитель — академик РАН, профессор А. Н. Ширяев

10 апреля — М.В. Болдин (МГУ им. М.В. Ломоносова)  
2019 г.

### *О локальной мощности тестов Колмогорова-Смирнова и Пирсона в авторегрессии*

Рассматривается  $AR(p)$  модель с неизвестными параметрами и распределением инноваций. По остаткам от оценок параметров строится подобие эмпирической функции распределения. На этой функции основываются статистики типа Колмогорова-Смирнова, омега-квадрат и хи-квадрат Пирсона для проверки гипотез относительно распределения инноваций. Найдена асимптотическая локальная мощность соответствующих тестов.

Результаты распространяются на авторегрессию с выбросами в наблюдениях.

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 2019 года назначен  
профессор Дмитрий Дмитриевич Соколов