

СЛУЧАЙНЫЕ ПРОЦЕССЫ. ПРЕОБРАЗОВАНИЕ ФУРЬЕ НАБЛЮДЕНИЙ

Труш Н. Н., Мирская Е. И. Случайные процессы. Преобразование Фурье наблюдений: Учеб. пособие. - Мн.: БГУ, 2000. - 60 с.



Настоящее учебное пособие является первой частью курса лекций «Статистический анализ временных рядов», читаемых к Белгосуниверситете на факультете прикладной математики и информатики и в Брестском госуниверситете им. Л. С. Пушкина на математическом факультете. В пособии рассматриваются основные характеристики случайных процессов и стационарных случайных процессов. Исследованы статистические свойства конечного преобразования Фурье и периодограммы, построенных по наблюдениям за стационарным случайным процессом. Указано предельное распределение конечного преобразования Фурье.

Оглавление

1. Случайные процессы и их основные характеристики. Примеры	3
2. Стационарные случайные процессы и их основные характеристики	18
3. Конечное преобразование Фурье и его статистические свойства	24
4. Предельное распределение конечного преобразования Фурье	34
5. Периодограмма и ее статистические свойства	48
6. Литература	59