

Název práce: Long range dependence v časových řadách

Autor: Alexander Till

Katedra/Ústav: Katedra pravděpodobnosti a matematické statistiky

Vedoucí diplomové práce: RNDr. Michaela Prokešová, Ph.D.

Abstrakt: Diplomová práce demonstruje potřebu studia long range dependence, představuje frakcionální Gaussovský šum a diskutuje možné definice dlouhé paměti, a to pomocí prostředků ergodické teorie a pomocí momentových charakteristik a spektrální hustoty. Tyto definice jsou konfrontované s modelem frakcionálního Gaussovského šumu a intuitivní představou o long range memory. Zkoumané jsou taky souvislosti a vztahy mezi jednotlivými určujícími kritérii. Práce je omezena na studium procesů s diskretním časem.