

## РЕФЕРАТ

Дипломна робота: \_ с., \_ рис., \_ табл., \_ додатки, \_ джерел.

### ПОРІВНЯЛЬНИЙ АНАЛІЗ МОДЕЛЕЙ ЧАСОВИХ РЯДІВ

Дана робота присвячена порівнянню і оцінці моделей прогнозування, а саме авторегресії з інтегрованим ковзним середнім (ARIMA) та авторегресії з дробовим інтегрованим ковзним середнім (ARFIMA).

Метою дипломної роботи є порівняти й оцінити моделі прогнозування, визначення кращої для різних часових рядів. Також реалізація моделей на різних програмних продуктах, таких як Python, R, SAS. Оскільки різні чисельні інструменти для аналізу часових рядів зазвичай дають досить різні, а іноді й радикально різні результати.

Об'єктом дослідження є стаціонарні і нестаціонарні часові ряди, пакети програмних продуктів, а також самі модель ARIMA та модель з довгою пам'яттю ARFIMA.