

СПИСОК КЛЮЧЕВЫХ ТЕМ, ЗНАНИЕ КОТОРЫХ НЕОБХОДИМО ДЛЯ ПОСТУПЛЕНИЯ
НА МАГИСТЕРСКУЮ ПРОГРАММУ
«СТАТИСТИЧЕСКИЙ И АНАЛИЗ ПРОГНОЗИРОВАНИЕ РИСКОВ»

1. Независимые случайные величины. Критерий независимости случайных величин.
2. Моменты случайных величин. Свойства математических ожиданий и дисперсий.
3. Центральная предельная теорема.
4. Точечные и интервальные оценки неизвестных параметров распределений. Свойства точечных оценок (несмещенность, состоятельность, эффективность, оптимальность). Два метода построения точечных оценок (метод максимального правдоподобия, метод моментов).
5. Основные понятия о проверке статистических гипотез. Лемма Неймана-Пирсона.
6. Доверительные интервалы для параметров нормального распределения.
7. Виды сходимости последовательностей случайных величин.

СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

1. Феллер В. Введение в теорию вероятностей и ее приложения, т.1, т.2. - М.: Мир, 1984.
2. Ивченко Г.И., Медведев Ю.И. Математическая статистика. - М.: Высшая школа, 1984.