

Рецензия на работу

Борисов И.С.

«О существовании стационарных последовательностей m -зависимых случайных величин с заданными корреляциями»

Работа посвящена проблеме существования стационарной в широком смысле последовательности с заданными начальными корреляциями. Получены необходимые условия того, что по заданным начальным корреляциям можно построить стационарную последовательность с последующими нулевыми корреляциями. Кроме того, обсуждаются достаточные условия, которые гарантируют существование стационарной последовательности (точнее m -ортогональной последовательности скользящего суммирования) с заданными корреляциями в качестве начальных. Изложение материала статьи отличается чёткостью и сопровождается наглядными примерами. Работа представляет интерес для специалистов в области теории вероятностей и статистического моделирования, и её можно рекомендовать к публикации в СЭМИ. Я бы посоветовал внести в текст работы небольшие изменения в связи со следующими замечаниями.

- 1) Мне кажется, что здесь вместо термина m -зависимость лучше использовать термин m -ортогональность.
- 2) Можно указать, что разрешимость системы уравнений (2) равносильна существованию последовательности скользящего суммирования с заданными начальными корреляциями. Нужно ли это формулировать в качестве отдельной теоремы – решать автору (систему (2) нетрудно найти в литературе по временным рядам, но ссылку на формулировку подобную приведённой автором мне быстро найти не удалось).