

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра математического моделирования и анализа данных

Дорошко
Ольга Валерьевна

Аннотация к дипломной работе
**«ИСПОЛЬЗОВАНИЕ ПОКАЗАТЕЛЯ ХЕРСТА ДЛЯ АНАЛИЗА ЦЕННЫХ
БУМАГ»**

Научный руководитель - кандидат физ.-мат. наук, доцент С.Н. Сталевская

АННОТАЦИЯ

Дипломная работа, 42 с., 14 рис., 3 табл., 11 источников.

Ключевые слова: ПОКАЗАТЕЛЬ ХЕРСТА, СРЕДНИЙ ИСТИННЫЙ ДИАПАЗОН, ИНДЕКС ОТНОСИТЕЛЬНОЙ СИЛЫ, ИНДЕКС ТОВАРНОГО КАНАЛА, АНАЛИЗ ЦЕННЫХ БУМАГ, ПОКАЗАТЕЛЬ ВОЛАТИЛЬНОСТИ

Объект исследования - показатель Херста в качестве основы для вычисления рыночных и экономических рядов данных с целью выяснить – случайны или не случайны они, а также получения дополнительной важной практической информации об этих явлениях.

Цель работы – исследование показателя Херста, его свойств, возможности применения при анализе ценных бумаг, сравнение с другими показателями волатильности и написание программного обеспечения для анализа ценных бумаг.

Методы исследования - эконометрический анализ, статистический анализ.

Результаты исследования – рассмотрен показатель Херста, способы его вычисления и свойства, показатель Херста и показатели CCI, ATR, RSI запрограммированы и проанализированы цены различных акций.

Область применения - в техническом анализе для обоснования предсказания тенденций.

ABSTRACT

Graduate work, 42 p., 14 images, 3 tab., 11 resources.

Keywords: HERST'S INDEX, AVERAGE TRUE RANGE, RELATIVE STRENGTH INDEX, COMMODITY CHANNEL INDEX, SECURITIES ANALYSIS, VOLATILITY INDEX

The object of the research - the Hurst index as the basis for computing market and economic data series in order to find out whether they are random or not, and also to obtain additional important practical information about these phenomena.

The aim of the research - to study the Hurst index, its properties, the possibility of applying it in the analysis of securities, comparison with other volatility indicators, and writing software for securities analysis.

Methods of research - econometric analysis, statistical analysis.

The results of the study - the Hurst index, methods of its calculation and properties, the Hurst index and CCI, ATR, RSI indicators are programmed and the prices of various stocks are programmed and analyzed.

The field of application - in the technical analysis to substantiate the prediction of trends.