

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ
БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
Механико-математический факультет
Кафедра функционального анализа и аналитической экономики

ИЗОТОВА
Анастасия Викторовна

Аннотация к дипломной работе
«Статистический анализ финансовых данных»

Научный руководитель – профессор Кротов Вениамин Григорьевич

2018

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 23 страницы, 4 литературных источника, 12 иллюстраций.

Ключевые слова: ТИКИ, ОДНОМЕРНЫЕ РАСПРЕДЕЛЕНИЯ, ВРЕМЕННОЙ РЯД, СТАЦИОНАРНЫЕ ПОСЛЕДОВАТЕЛЬНОСТИ, АВТОРЕГРЕССИЯ, СКОЛЬЗЯЩЕЕ СРЕДНЕЕ, АВТОРЕГРЕССИЯ СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО.

Целью дипломной работы является статистический анализ, изучение временных рядов и некоторых методов их прогнозирования.

В дипломной работе изучается статистика одномерных распределений, теория временных рядов и возможность прогнозирования на основе имеющихся данных с помощью моделей временных рядов.

Статистический анализ финансовых данных является актуальным в настоящее время. Широких применений имеет на финансовом рынке. Построение прогноза цен акций, изменения курса валют, стоимости ценных бумаг и так далее.

Для обобщения изложенной теории в дипломной работе приведен пример построения прогноза курса евро к доллару. В нем детально описан способ анализа и подбор модели для построения прогноза на ближайшие две недели.

ABSTRACT

Diploma thesis: 23 pages, 4 reference sources, 12 figures.

Key words: TICKS, ONE-DIMENSIONAL DISTRIBUTIONS, TIME SERIES, STATIONARY SEQUENCES, AUTHOREGRESSION, SLIDING MEDIUM, AUTHOREGRESSION OF THE SLIDING MEDIUM.

The purpose of the thesis is statistical analysis, the study of time series and some methods for predicting them.

In the diploma thesis the statistics of one-dimensional distributions, the theory of time series and the possibility of predicting on the basis of available data using time series models are studied.

Statistical analysis of financial data is current at present. It has wide applications in the financial market: construction of the forecast of stock prices, changes in the exchange rate, the value of securities, and so on.

To summarize the theory presented in the thesis, an example of constructing a forecast of the euro-dollar exchange rate is given. It details the method of analysis and the selection of the model for building the forecast for the next two weeks.