

**МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ**  
**БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ**  
**ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ**  
**Кафедра теории вероятностей и математической статистики**

Аннотация к дипломной работе

**Анализ моделей финансовых данных**

Шапиро Игорь Александрович

Научный руководитель — доцент кафедры ТВиМС, кандидат физ.—мат. наук  
Меленец Ю.В

Минск, 2022

## РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 35 с., 9 источников, 1 приложение.

**Ключевые слова** – ВРЕМЕННОЙ РЯД, ПРОЦЕСС АВТОРЕГРЕССИИ, ПРОЦЕСС СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО, ПРОЦЕСС АВТОРЕГРЕССИИ – СКОЛЬЗЯЩЕГО СРЕДНЕГО.

**Объект исследования** – финансовые данные.

**Цель работы** – исследовать финансовые данные при помощи моделей временных рядов.

**Результаты работы** – при помощи программной реализации и теоретических сведений о временных рядах проведен анализ реальных данных.

## РЭФЕРАТ

Дыпломная работа, 35 с., 9 крыніц, 1 прыкладанне.

**Ключавыя словы** – ЧАСОВАЙ ШЭРАГ, ПРАЦЭС АВТОРЕГРЕССИИ, ПРАЦЭС СЛІЗГАЛЬНАГА СЯРЭДНЯГА, ПРАЦЭС АВТОРЕГРЕССИИ— СЛІЗГАЛЬНАГА СЯРЭДНЯГА.

**Аб'ект даследавання** – фінансавыя дадзеныя.

**Мэта работы** – даследаваць фінансавыя дадзеныя пры дапамозе мадэляў часовых шэрагаў.

**Вынікі работы** – пры дапамозе праграмнай рэалізацыі і тэарэтычных звестак аб часовых шэрагах праведзены аналіз рэальных дадзеных.

## **ABSTRACT**

Graduation work, 35 p., 9 sources, 1 appendix.

**Keywords** – TIME SERIES, AUTOREGRESSIVE PROCESS, MOVING AVERAGE PROCESS, AUTOREGRESSIVE – MOVING AVERAGE PROCESS.

**Object of research** – financial data.

**Objective** – investigate financial data using time series models.

**Result** – with the help of software implementation and theoretical information about time series, the analysis of real data was carried out.