

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ
БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
МЕХАНИКО-МАТЕМАТИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ

Кафедра функционального анализа и аналитической экономики

Ярошевич
Антон Сергеевич

Аннотация к дипломной работе:

ВЕРОЯТНОСТНО-СТАТИСТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ
В ТЕХНИЧЕСКОМ АНАЛИЗЕ

Научный руководитель:
доктор физ.-мат. наук,
профессор В.Г. Кротов

Минск, 2022 г

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 24 страницы, 5 использованных источников.

Ключевые слова: СТОХАСТИЧЕСКИЙ БАЗИС, СЛУЧАЙНЫЙ ПРОЦЕСС, ВИНЕРОВСКИЙ ПРОЦЕСС, Н-ФЛУКТУАЦИЯ, Н-ВАРИАЦИЯ, Н-ИНВЕРСИЯ, Н-ВОЛАТИЛЬНОСТЬ, RENKO- И KAGI-МЕТОДЫ, RENKO- И KAGI-Н-СТРАТЕГИИ.

Главной целью дипломной работы является подробное описание и обоснование некоторых методов технического анализа, используемых на рынке, с точки зрения финансовой математики и стохастического анализа.

Настоящая работа посвящена изучению и описанию некоторых методов технического анализа финансового рынка. Под техническим анализом здесь понимается статистический анализ процессов, описывающих поведение цен и объемов сделок и заявок на покупку или продажу финансовых активов, с целью прогнозирования будущего поведения цен. Основное внимание уделено построениям и моделям kagi и renko, которые лежат в основе трейдинговых стратегий, позволяющих реализовать имеющиеся на рынке арбитражные возможности.

Актуальность работы обусловлена теоретической и практической ценностью материала. Ряд исследованных понятий носит теоретический характер. Практическая ценность заключается в том, что результаты работы могут эффективно использоваться на финансовом рынке или быть задействована в любой другой сфере экономики, где имеется адекватная статистика.

Дипломная работа выполнена автором самостоятельно.

ABSTRACT

Diploma thesis: 24 pages, 5 references.

Key words: STOCHASTIC BASIS, RANDOM PROCESS, WIENER PROCESS, $\mathbb{H}$ -FLUCTUATION, $\mathbb{H}$ -VARIATION, $\mathbb{H}$ -INVERSION, $\mathbb{H}$ -VOLATILITY, RENKO- AND KAGI-METHODS, RENKO- AND KAGI- $\mathbb{H}$ -STRATEGIES.

The main purpose of the thesis is a detailed description and justification of some methods of technical analysis used in the market, from the point of view of financial mathematics and stochastic analysis.

This work is devoted to the study and description of some methods of technical analysis of the financial market. Technical analysis here refers to the statistical analysis of processes describing the behavior of prices and volumes of transactions and applications for the purchase or sale of financial assets, in order to predict future price behavior. The main attention is paid to the constructions and models of kagi and renko, which are the basis of trading strategies that allow you to realize the arbitrage opportunities available on the market.

The relevance of the work is due to the theoretical and practical value of the material. A number of the studied concepts are theoretical in nature. The practical value lies in the fact that the results of the work can be effectively used in the financial market or be involved in any other area of the economy where adequate statistics are available.

The thesis was done by the author independently.