

А. И. Римашевская, Л. К. Рамская, С. В. Сидак

Брест, БрГТУ

**ИССЛЕДОВАНИЕ ФРАКТАЛЬНЫХ ХАРАКТЕРИСТИК
ФИНАНСОВЫХ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ**

Совершенствование в сфере компьютерных технологий, развитие методов математического моделирования, автоматизация бизнес-процессов позволяют, помимо вычисления базовых статистических параметров финансовых временных рядов, использовать и адаптировать более сложные математические методы, применение которых позволяет вычислять параметры, отражающие неявные, скрытые свойства финансовых процессов. Инструментом, обладающим перечисленными выше свойствами и получившим в последнее время широкое развитие в самых разнообразных областях науки, является фрактальный анализ. В работе исследована персистентность временного ряда официальных курсов белорусского рубля по отношению к доллару США, устанавливаемых Национальным банком

Республики Беларусь ежедневно, за период с 03.01.2011 по 05.04.2022. Алгоритм вычисления показателя Хёрста, характеризующего фрактальные свойства временного ряда, полностью автоматизирован авторами в Excel+VBA.