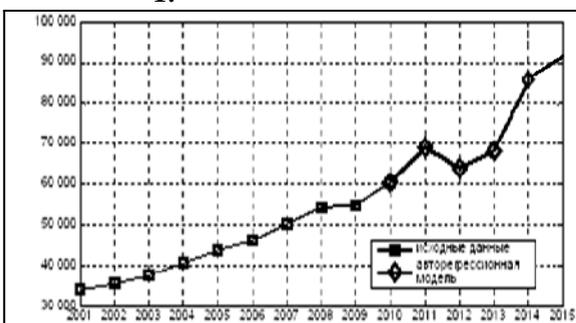




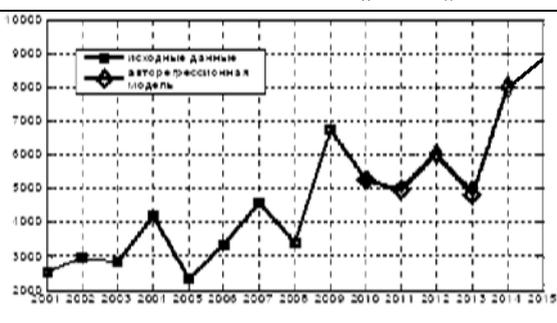
2.) , ( - ) [1], [2]. ( : ) ; ) ; ) « » ( .1). « » , » ,

1.

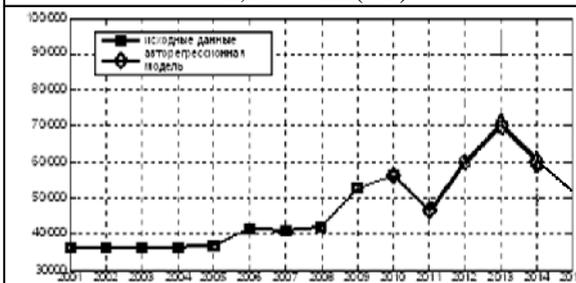
« » \*



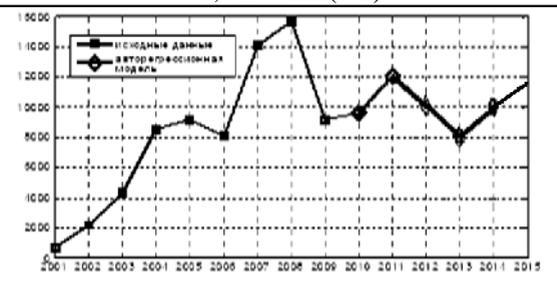
$$X1(t) = 1,043 \times X1(t-5) - 3,593 \times X1(t-4) + 3,935 \times X1(t-3) - 1,485 \times X1(t-2) + 1,154 \times X1(t-1)$$



$$X2(t) = 1,293 \times X2(t-5) - 0,886 \times X2(t-4) + 0,303 \times X2(t-3) + 0,158 \times X2(t-2) + 0,488 \times X1(t-1)$$



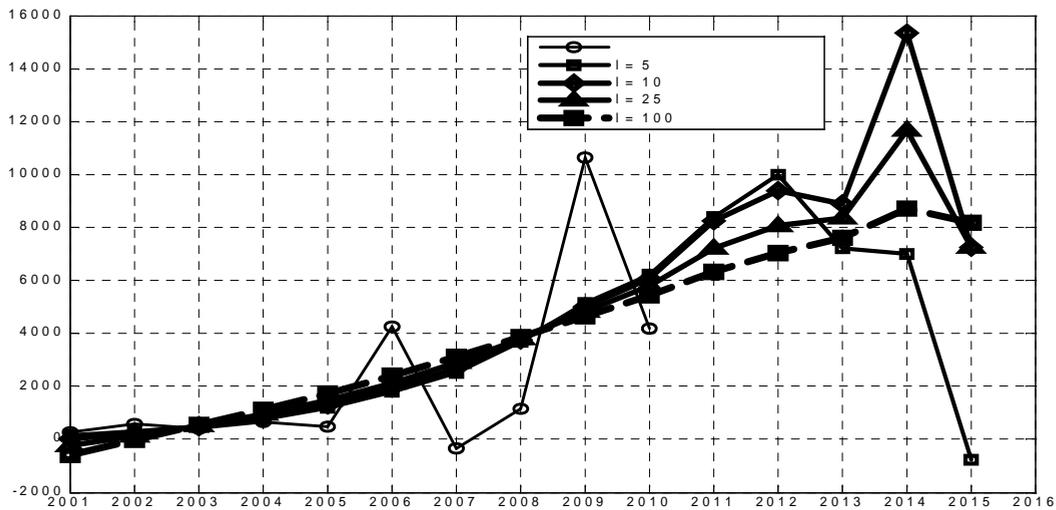
$$X3(t) = 0,007 \times X3(t-1) - 0,061 \times X3(t-2) + 2,275 \times X3(t-3) + 1,29 \times X3(t-4) - 2,388 \times X3(t-5)$$



$$X4(t) = 1,21 \times X4(t-1) - 0,63 \times X4(t-2) + 1,054 \times X4(t-3) - 0,661 \times X4(t-4) - 0,12 \times X4(t-5)$$

\*

2014 ., 2001 2009 . 2013 .



1. « »,  $l$  ( )

( $l=5$ ), ( $l=10$ ) -  $l$

3.

;

( [5]. )  $R/S$

$S = 0,85$   $S$  2004-2006  $a=1$   $a=0,5$ .

2013-2015 .

4.

3,

( 2),

5.

( 2)

( 3). ( 1),

2. R/S

« » \*

	Набор 1			Набор 2			Набор 3			Набор 4			Набор 5		
	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015
Прибыль	254,9	585,1	402,6	653,9	463,8	4243,9	-345,1	1154	10641	4188	8383,1	9999,3	7229	7014,5	-758,8
Среднее значение	414,2			1787			3816			7523			4494,9		
Стандартное отклонение	135,05			1738,9			4864,2			2449			3715,9		
Накопленное отклонение	-159,3	11,6	0	-1133,3	-2456,7	0	-4161,7	-6824,4	0	-3335,5	-2475,8	0	2734,1	5253,7	0
Размах накопленного отклонения	170,9			2456,7			6824,4			3335,5			5253,7		
Нормированное отклонение	1,2654			1,4128			1,403			1,3619			1,4138		
Логарифм нормированного отклонения	0,2354			0,3456			0,3386			0,3089			0,3463		
Логарифм числа периодов	1,0986			1,0986			1,0986			1,0986			1,0986		
Показатель	$a = 1$			0,2143			0,3082			0,2812			0,3152		
	$a = 0,5$			0,5806			0,8351			0,7618			0,8541		

\*



