

Бікрамадітъя Гхош, Кришна М.К., Шринкант Рао, Еміра Козаревіч, Рахул Кумар Пандей

Прогнозованість та стадна поведінка на фоні волатильності на фондовому ринку з точки зору еконофізики

Число Рейнольдса є фінансовим показником волатильності на фондовому ринку. Стаття допоможе визначити прогнозованість та стадну поведінку, які показує число Рейнольдса (часові ряди) для індексів CNX Nifty для біржових сесій та CNX Nifty для високочастотного трейдингу. Для дослідження було використано показник Херста та фрактальна розмірність. Результати підтверджують незаперечні докази прогнозованості та стадної поведінки для обох індексів. Однак, було виявлено, що індекс CNX Nifty для високочастотного трейдингу (представлений відповідним йому числом Рейнольдса) є більш прогнозованим і має ознаки сильно вираженої стадної поведінки. Автори виявили, що в основі прогностичної моделі лежить квадратне рівняння.

Ключові слова: еконофізика, показник Херста, стадна поведінка, високочастотний трейдинг.

Класифікація JEL: A12, B4, D53, G1.



Стаття знаходиться у відкритому доступі і може розповсюджуватися на умовах ліцензії [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/), що дозволяє повторне використання, розповсюдження та відтворення, забороняє використання матеріалів у комерційних цілях та вимагає наявності відповідного посилання на оригінальну версію статті.

Бикрамадितъя Гхош, Кришна М.К., Шринкант Рао, Эмира Козаревич, Рахул Кумар Пандей

Прогнозируемость и стадное поведение на фоне волатильность на фондовом рынке с точки зрения эконофизики

Число Рейнольдса является финансовым показателем волатильности на фондовом рынке. Статья поможет определить прогнозируемость и стадное поведение, показываемые числом Рейнольдса (временными рядами) для индексов CNX Nifty для биржевых сессий и CNX Nifty для высокочастотного трейдинга. Для исследования были использованы показатель Хёрста и фрактальная размерность. Результаты подтверждают неопровержимые доказательства прогнозируемости и стадного поведения для обоих индексов. Однако, было выявлено, что индекс CNX Nifty для высокочастотного трейдинга (представленный соответствующим ему числом Рейнольдса) является более прогнозируемым и имеет признаки сильно выраженного стадного поведения. Авторы выявили, что в основе прогностической модели лежит квадратное уравнение.

Ключевые слова: эконофизика, показатель Хёрста, стадное поведение, высокочастотный трейдинг.

Классификация JEL: A12, B4, D53, G1.



Статья находится в открытом доступе и может распространяться на условиях лицензии [Creative Commons Attribution-NonCommercial 4.0 International license](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/), что позволяет повторное использование, распространение и воспроизведение, запрещает использование материалов в коммерческих целях и требует присутствия соответствующей ссылки на оригинальную версию статьи.