



Identyfikacja, implementacja i ewaluacja korekt w metodyce szacowania wymiaru fraktalnego finansowych szeregów czasowych opartej na metodzie wariacyjnej

W świetle dotychczasowej ewolucji podejścia do kwantyfikacji ryzyka inwestycyjnego rozwinięcie metodyki szacowania wymiaru fraktalnego jawi się właściwie jako nieuchronna konieczność. Dogłębne poznanie natury procesów zachodzących na rynku finansowym wymaga znajomości ich charakterystyk ilościowych. Opis ów, mając na względzie koncepcje modelowania fraktalnego (nabierające niekiedy wręcz cech nowego paradygmatu w nauce finansów), nie może być kompletny bez określenia własności fraktalnych badanych procesów. Tym samym badania mające koncentrować się na zgłębianiu fraktalnej natury wielkości opisujących rozmaite instrumenty finansowe, są w istocie rzeczy niemożliwe do przeprowadzenia bez odpowiedniego zaplecza metodycznego. Opisywane działanie ma za zadanie pokonanie owej przeszkody. Jego celem naukowym jest określenie, czy zasadnicza idea przyświecająca konstrukcji metod szacowania wymiaru fraktalnego finansowych szeregów czasowych – metody segmentowo-wariacyjnej oraz metody podziału pola – umożliwi wprowadzenie korekt skutkujących otrzymaniem oszacowań w znaczącym stopniu poprawniej oddających rzeczywisty wymiar fraktalny oraz cechujących się większą stabilnością.

Instytucja koordynująca:	 NARODOWE CENTRUM NAUKI
Źródło finansowania:	 MINIATURA 4
Numer wniosku/umowy:	2020/04/X/HS4/00051
Okres realizacji:	01.10.2020 r. - 30.09.2021 r.
Wartość projektu:	16 767 PLN

