

Бронштейн Е.М., Зинурова А.Р.
Уфа, УГАТУ

G-КОПУЛА ФУНКЦИИ КО- И КОНТРОМОНОТОННОГО ТИПА И ИХ ПРИЛОЖЕНИЕ К АНАЛИЗУ ФИНАНСОВОГО РЫНКА

Выделен класс копула функций, порожденных функциями одной переменной, в том числе, обобщенными. Последние естественным образом разделяются на функции ко- и контрмонотонного типа. На этой основе исследована динамика характера зависимости временных рядов курсов акций различных компаний.

Ключевые слова: копула функция, комонотонность, контрмонотонность, независимость, курсы акций.

Bronshtein E.M., Zinurova A.R.
Ufa, USATU

G – COPULA FUNCTIONS OF COMONOTONIC AND COUNTERMONOTONIC TYPES AND THEIR APPLICATIONS TO THE ANALYSIS OF FINANCIAL MARKET

The class of copula functions generated by functions of one variable, including distributions, is defined. The last can be separated naturally on the functions of comonotonic and contramonotonic types. On this basis is researched the dynamics of dependence of various companies stock prices time series.

Keywords: copula function, comonotonicity, contrmonotonicity, independence, stock prices.