

**Глухих И.Ю.**  
*Санкт-Петербург, ФГБОУ ВПО РАНХИГС СЗИ*

## **ПРИМЕНЕНИЕ МЕТОДА ФРАКТАЛЬНОГО АНАЛИЗА ДИНАМИКИ ХАРАКТЕРИЗУЮЩИХ ФИНАНСОВОЕ СОСТОЯНИЕ ПРЕДПРИЯТИЙ КОЭФФИЦИЕНТОВ**

В статье рассматривается пример применения метода фрактального анализа для изучения свойств динамических структур финансовых коэффициентов двух предприятий с различными уровнями финансовой устойчивости. Для этого проводится оценка параметра Херста, вычисленного методом нормированного размаха с использованием метода главных компонент.

**Ключевые слова:** фрактал, фрактальный процесс, самоподобный процесс, персистентность, метод нормированного размаха, метод главных компонент

**Glukhikh I.Iu.**  
*S.-Petersburg, RANEPА NWI*

## **AN APPLICATION OF THE METHOD OF THE FRACTAL ANALYSIS OF DYNAMICS OF THE FACTORS CHARACTERIZING THE FINANCIAL SOLVENCY OF THE ENTERPRISES**

In article is considered the example of application of the method of the fractal analysis for studying of properties of dynamic structures of financial factors of two enterprises with various levels of financial stability. For this purpose there is the estimation of parameter of Hurst calculated by a method of the rescaled range with use of a method of the principal component analysis.

**Keywords:** fractal, fractal process, self-similar process, persistence, a method of the rescaled range, the principal component analysis