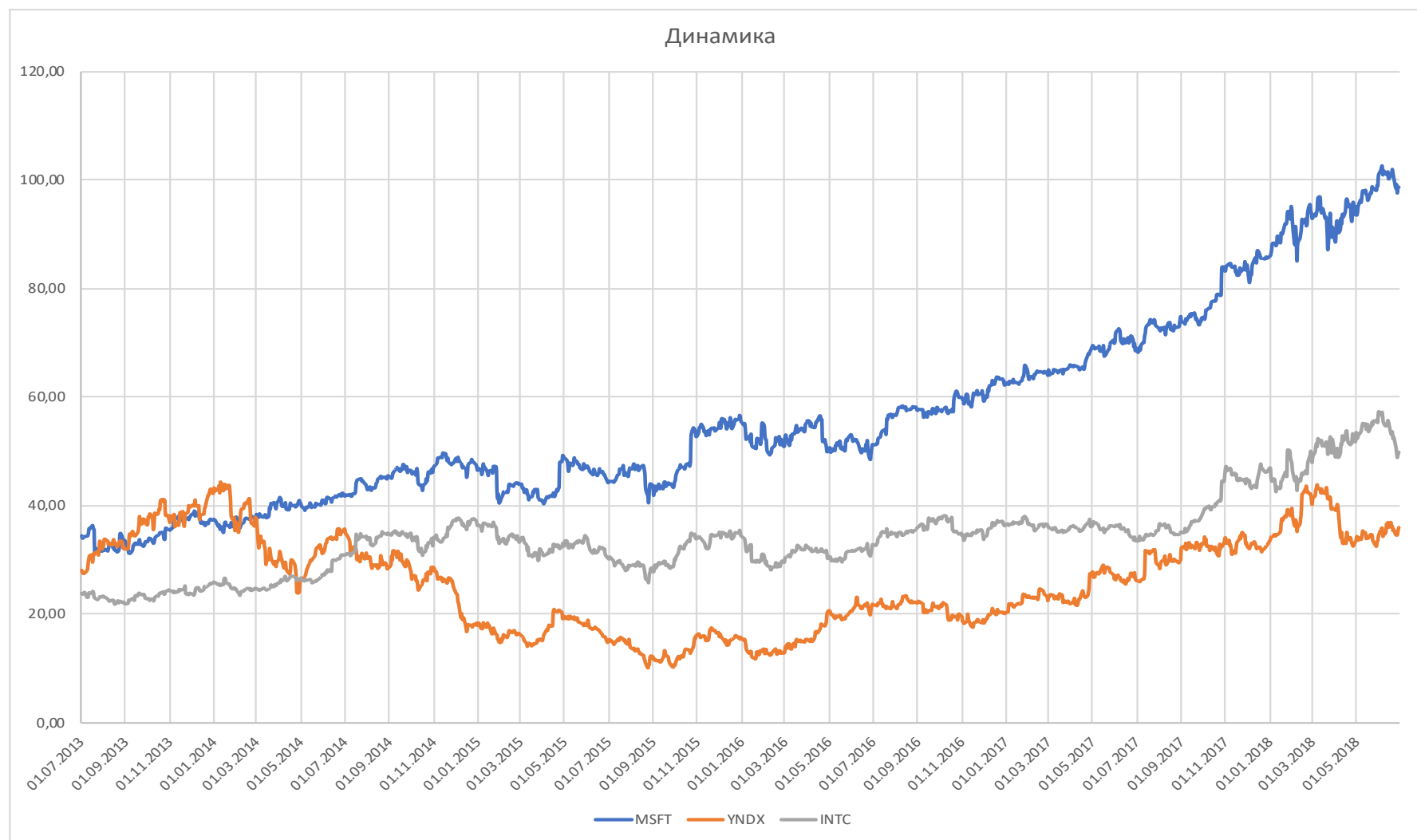


Отчет по производственной практике

Исходные данные



Проверка на коинтеграцию

Microsoft - Yandex

delta_e на e(t-1)	
0,0000770	0,04783333
0,0013149	0,02268309
0,0000027	0,80484897
0,0034321	1257
0,0022232	814,261794
krit	0,059
tabl	-1,94

MSFT на YNDX			YNDX на MSFT	
0,51	42,81		0,12	19,07
0,06	1,54		0,01	0,78
0,06	17,29		0,06	8,38
83,21	1258		83,21	1258
24874,84	376057,80		5838,72	88269,78
t_кр	9,12		t_кр	9,12
t_табл	2,2441		t_табл	2,2441

Microsoft - Intel

delta_e на e(t-1)	
-0,0102275	0,005226401
0,0041201	0,028157028
0,0048783	0,999078243
6,1621354	1257
6,1507806	1254,683771
krit	-2,482
tabl	-1,94

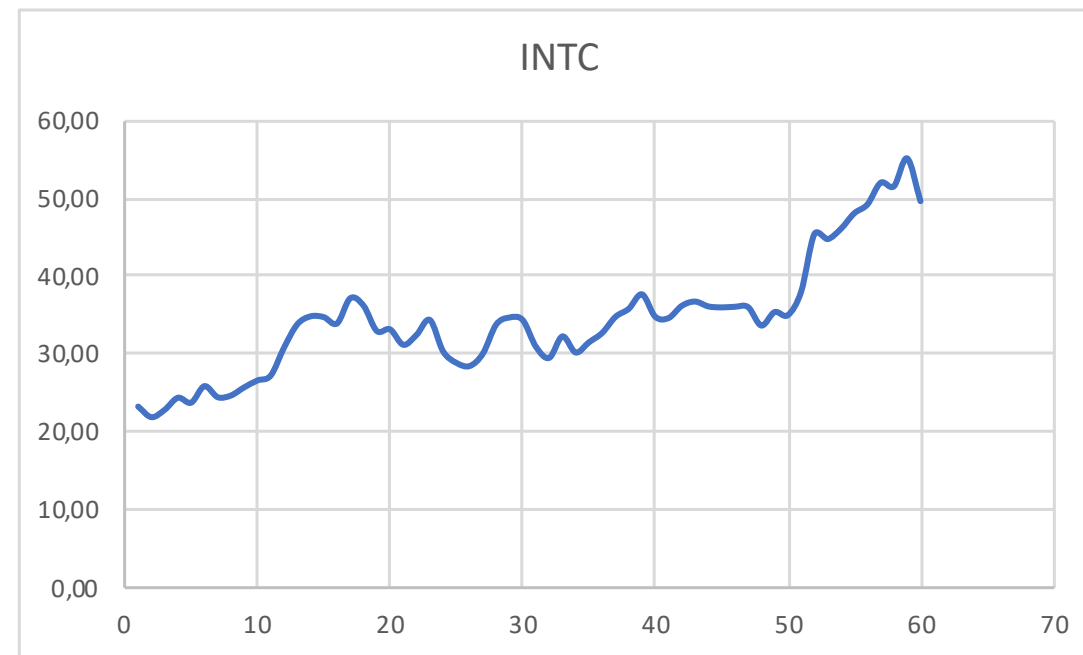
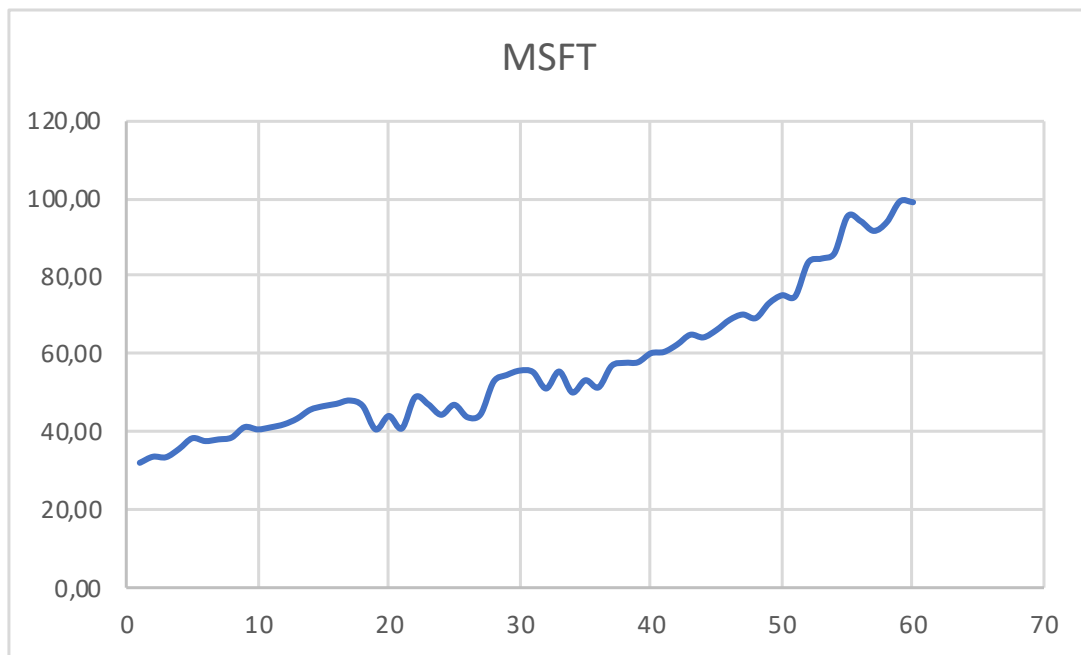
MSFT на INTC			INTC на MSFT	
2,23	-19,95		0,38	12,64
0,03	0,91		0,00	0,26
0,85	6,84		0,85	2,83
7310,85	1258		7310,85	1258
342071,41	58861,23		58662,39	10094,21
t_кр	85,50		t_кр	85,50
t_табл	2,2441		t_табл	2,2441

Yandex - Intel

delta_e на e(t-1)	
-0,0030297	0,002209023
0,0022555	0,019222343
0,0014334	0,682054508
1,8043122	1257
0,8393631	584,7543277
krit	-1,343
tabl	-1,94

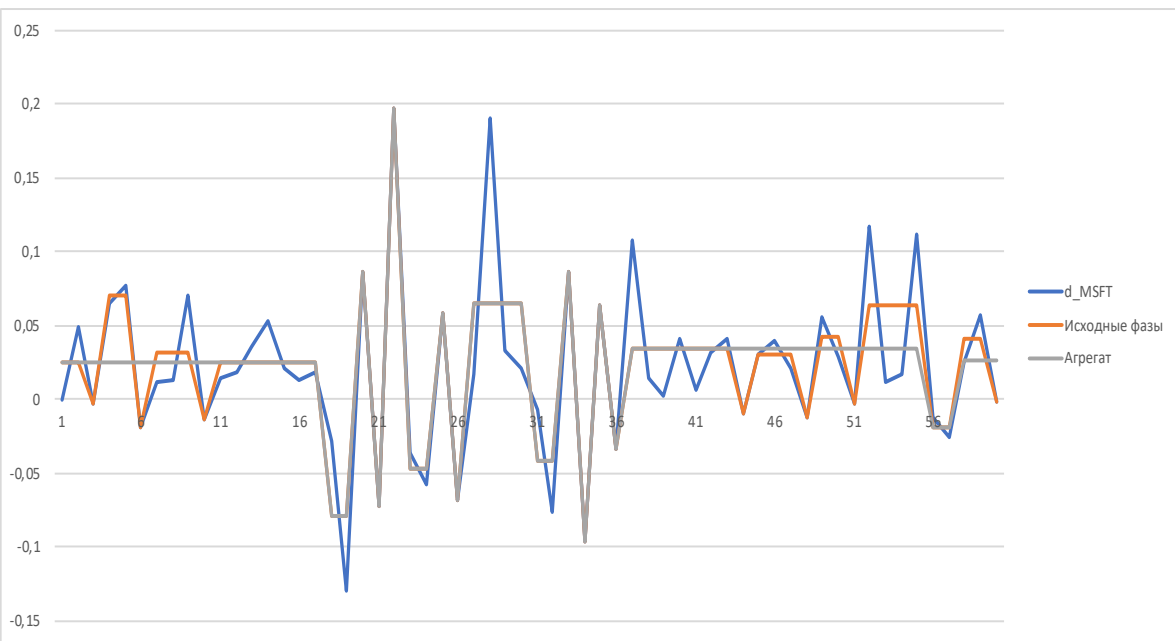
YNDX на INTC			INTC на YNDX	
0,20	19,18		0,14	30,41
0,03	1,13		0,02	0,65
0,03	8,53		0,03	7,29
35,99	1258		35,99	1258
2617,25	91491,25		1912,19	66844,41
t_кр	6,00		t_кр	6,00
t_табл	2,2441		t_табл	2,2441

Фазовый анализ



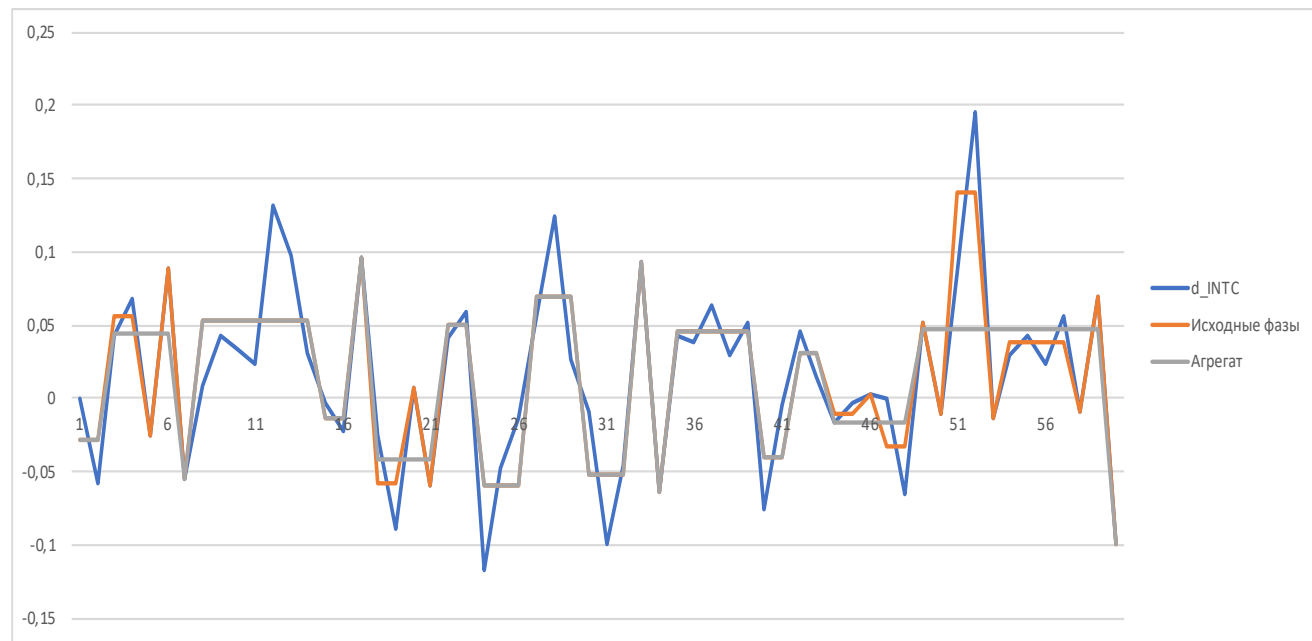
Фазовый анализ

Microsoft



Средний прирост	4,88%
Среднее падение	-3,76%
Средняя продолжительность фазы роста	2,73
Средняя продолжительность фазы падения	1,26
Количество фаз роста	15
Количество фаз падения	15

Intel



Средний прирост	5,62%
Среднее падение	-4,16%
Средняя продолжительность фазы роста	2,26
Средняя продолжительность фазы падения	1,62
Количество фаз роста	15
Количество фаз падения	16

Анализ остатков модели ARIMA (1, 2, 0)

