

В. О. Кривицкий
(УО «ГГУ им. Ф. Скорины», Гомель)

ВЗАИМОСВЯЗЬ ДИНАМИКИ КРИПТОВАЛЮТ

Криптовалюта может приниматься для оплаты услуг и покупки различных товаров в сети Интернет совершенно анонимно. Помимо этого, благодаря криптовалюте можно без труда совершать международные платежи, так как биткоин и его аналоги не привязаны ни к одной отдельной стране. Исследование динамики корреляции различных активов применяется для формирования портфеля активов, а также для уменьшения риска торговых операций, построения торговых стратегий на фондовом рынке, в том числе и валютном. Поэтому исследования наличия взаимосвязи между курсовыми ценами криптовалют весьма актуально.

Проведен анализ динамики цен закрытия курсов криптовалют биткоина (BTC), дэша (DASH), эфириума (ETC), лайткоина (LTC) по отношению к доллару США (USD). Информационно-статистической базой исследований послужили ежемесячные данные за период с 01.01.2016 по 31.12.2018 [1].

Показано, что курсы криптовалют ETC/USD, LTC/USD, DASH/USD начиная с 01.07.2017 находятся в достаточно высокой взаимосвязи с курсом BTC/USD, а криптовалюта LTC/USD наиболее коррелирует только с BTC/USD.

Анализ кросс-корреляционных функций темпов цен закрытия курсов криптовалют ETC/USD, LTC/USD, DASH/USD по сравнению с BTC/USD, показал, что временная задержка в темпах изменения курсов криптовалют по сравнению с динамикой BTC/USD наблюдалась в курсах ETC/USD и DASH/USD, и равна три месяца. Что касается криптовалюты LTC/USD, то здесь темпы колебаний цены совпадают с курсом BTC/USD.

Полученные результаты могут применяться на рынке криптовалют при анализе их динамики для принятия грамотных финансовых решений.

Литература

1 Кобзарь, А. И. Прикладная математическая статистика : для инженеров и научных работников / А. И. Кобзарь. – М. : Физматлит, 2006. – 816 с.