

# Stabilizacja postaci modeli ARIMA dla notowań po debiucie giełdowym

**Kacper Paczutkowski**  
**Konrad Furmańczyk**

Instytut Informatyki Technicznej SGGW

Rozważamy modele szeregów czasowych klasy ARiMA opisujących notowania spółek giełdowych w ich początkowych okresach od debiutu na Rynku Głównym GPW. Dokonany jest przegląd statystyk ilościowych obrazujących badany obszar rynku GPW w latach jego dotychczasowej działalności. Wyznaczono modele ARiMA dla poszczególnych spółek w każdy z kolejnych dni od ich giełdowego debiutu. Określono także numery notowań, po których dla każdej spółki można było odnotować sekwencje takiej samej klasy modelu. W wyniku badań sformułowano wnioski dotyczące tego ile czasu (notowań) po debiucie musiało upłynąć, by klasa modelu się stabilizowała. Obliczenia wykonano w pakiecie R. Wykorzystano krokowe podejście wyboru modelu za pomocą procedury `auto.arima`, dostępnej w ramach biblioteki *forecast*.

## **Literatura**

- [1] B. Hyndman, Y. Khandakar (2008), *Automatic Time Series Forecasting: The forecast Package for R*, Journal of Statistical Software, Articles, 27(3), 1–22, doi:10.18637/jss.v027.i03