

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 72 с., 40 рис., 7 табл., 24 джерел, 2 додатки.

Об'єкт дослідження – часові ряди інструментів фінансових ринків.

Предмет дослідження – моделі, методи та технології прогнозування часових рядів інструментів фінансових ринків.

Мета роботи – визначити оптимальні набори тайм-фреймів для прогнозування значень цін фінансових інструментів та розробити модель для ефективнішого прогнозу.

В роботі реалізований програмний додаток, що дозволяє проводити дослідження у відповідності до мети роботи. Розглянуті величини тайм-фреймів, на яких можна виконувати прогнозування методами Back Propagation, метод головних компонент SSA та авторегресія. Проведений порівняльний аналіз ефективності методів та експериментально побудована модель оптимізації прогнозу за рахунок агрегації різних довжин тайм-фреймів. В роботі також представлені результати досліджень у табличному та графічному вигляді.

Результати роботи апробовано на 18 міжнародній конференції «SAIT-2016».

НЕЙРОННІ МЕРЕЖІ, ПРОГНОЗУВАННЯ, BACK PROPOGATION, SSA, АВТОРЕГРЕСІЯ, FOREX, ТАЙМ-ФРЕЙМ