

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 112 с., 41 рис., 10 табл., 2 додатки, 11 джерел.

Об'єкт дослідження: нестационарні процеси ціноутворення на біржі, представлені часовими рядами.

Мета роботи: побудова математичних моделей вибраних біржових процесів; оцінювання прогнозів; розробка програмного забезпечення для виконання обчислювальних експериментів.

Метод дослідження: математичні моделі і методи аналізу процесів на біржі.

В роботі проведений огляд способів інвестування в цінні папери. Наведено деякі відомі методи прогнозування цін акцій на біржі. Розглянуто і проаналізовано два комерційних програмних продукти для статистичної обробки даних

Створено інформаційну аналітичну систему для моделювання та прогнозування процесів на біржі на базі авторегресійних моделей з ковзним середнім. В проекті представлені результати прогнозування вибраних цін акцій за допомогою як власно створеного програмного продукту, та і уже існуючих продуктів для статистичної обробки даних.

Система реалізована на базі платформи .Net Framework 4.5 з використанням мови програмування С#, наведено приклади застосування програми для прогнозування реальних цін акцій. Розглянуто шляхи можливого подальшого вдосконалення системи.

СТАЦІОНАРНІ ПРОЦЕСИ, ІНТЕГРОВАНІ ПРОЦЕСИ, ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНІ ПРОЦЕСИ, МОДЕЛЬ АВТОРЕГРЕСІЇ КОВЗНОГО СЕРЕДНЬОГО, АВТОРЕГРЕСІЙНА УМОВНО ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНА МОДЕЛЬ, СИСТЕМА ПІДТРИМКИ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ.