

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 106с., 36 рис., 10 табл., 23джерел, 2 додатки.

Об'єкт дослідження: нестационарні процеси в економіці та фінансах.

Предмет дослідження: методи прогнозування гетероскедастичних та інтегрованих процесів.

Мета дослідження: розробка програмного забезпечення для побудови математичних моделей нестационарних процесів, проведення порівняльного аналізу та вибір кращої моделі.

В роботі досліджуються нестационарні процеси у фінансово-економічній сфері, способи їх моделювання за допомогою моделей інтегрованих та гетероскедастичних процесів – поліноміального та експоненціального тренду, АР, АРКС, АРІКС, АРУГ та УАРУГ. В багатьох системах, зокрема, у фінансово-економічній сфері широко поширені процеси даного типу, вони використовуються для прогнозування та менеджменту ризиків, формуванні бюджетів підприємств, оцінювання альтернативних економічних стратегій та ін.

В роботі розроблений програмний продукт в середовищі Matlab, в якому виконано порівняльний аналіз способів оцінювання параметрів рівних моделей нестационарних процесів, зроблено вибір кращої моделі та побудовано її короткострокову оцінку. Результати, що були отримані, можуть бути використані ОПР для подальшого прийняття рішень.

ПРОЦЕС З ТРЕНДОМ, АВТОРЕГРЕСІЯ, УМОВНА ДИСПЕРСІЯ,
ГЕТЕРОСКЕДАСТИЧНИЙ ПРОЦЕС, КОРОТКОСТРОКОВЕ
ПРОГНОЗУВАННЯ, СИСТЕМА ПІДТРИМКИ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ