

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 159с., 62 рис., 15 табл., 2 додатки, 15 джерел.

Об'єкт дослідження: нелінійні нестационарні процеси в економіці та фінансах, представлені часовими рядами.

Мета роботи: побудова математичних моделей для процесів в економіці та фінансах; оцінювання прогнозів; розробка програмного забезпечення для виконання обчислювальних експериментів.

Метод дослідження: математичні моделі і методи аналізу процесів в економіці та фінансах.

Створено інформаційну аналітичну систему для моделювання та прогнозування процесів в економіці та фінансах на базі авторегресійних моделей з ковзним середнім. В проекті представлені результати прогнозування вибраних цін активів за допомогою як власно створеного програмного продукту, так і вже 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.

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

