

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 78 с., 31 рис., 6 табл., 2 дод., 13 джерел.

АДАПТИВНИЙ МЕТОД ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ ДЛЯ РИНКУ ЦІННИХ ПАПЕРІВ, ЕФЕКТУАЦІЙНА КОНЦЕПЦІЯ, СИСТЕМИ ПРИЙНЯТТЯ РІШЕНЬ, ГРАДІЄНТНИЙ БУСТИНГ

Об'єкт дослідження – Фінансові часові ряди цінних паперів, історія торгівельних операцій.

Предмет дослідження – Методи класифікації, що базуються на машинному навчанні.

Мета роботи – Проаналізувати предмет дослідження, реалізувати безперервний доступ до трейдингових даних, провести тестування побудованої моделі на історичних даних та в режимі реального часу.

Методи дослідження – методи машинного навчання: дерева прийняття рішень, випадковий ліс, нейронні мережі, градієнтний бустинг.

Актуальність – задача прийняття рішень на ринках цінних паперів є провідною для сучасного світу. Побудова стратегій з низьким ступенем ризику є оптимальним вибором для збереження пасивів будь-якого підприємства. Побудована модель може бути легко перенесена на будь-який ринок, в основі якого лежить часовий ряд та контрагентами ряду виступають рівноправні користувачі без значної переваги.

Результати роботи свідчать досягнення рентабельності використання активів при застосуванні моделі на рівні середньої банківської ставки 8% в місяць.

Шляхи подальшого розвитку предмету дослідження – збільшити кількості залучених параметрів активів в моделі; застосувати стратегії для торгівлі іншими фінансовими інструментами та адаптувати модель для проведення операцій між декількома парами активів.