

Аннотация дипломной работы

Тема: разработка системы анализа и прогнозирования стохастических процессов.

Студент: Македон Евгений Владимирович

Научный руководитель: Рябый Вячеслав Васильевич, старший преподаватель кафедры многопроцессорных систем и сетей.

Кафедра: кафедра многопроцессорных систем и сетей.

Объём и структура дипломной работы: 60 страниц, 29 рисунков, 11 источников, 5 глав.

Ключевые слова: СТОХАСТИЧЕСКИЙ ПРОЦЕСС, ВРЕМЕННОЙ РЯД, ПРОГНОЗИРОВАНИЕ, НЕЙРОННАЯ СЕТЬ, БИРЖЕВАЯ ТОРГОВЛЯ.

Цель работы: изучение статистических и нестатистических методов анализа стохастических процессов с целью прогнозирования их поведения. Проведение анализа возможности применения данных методов к задачам прогнозирования. Разработка метода анализа и прогнозирования для стохастического процесса изменения биржевого курса.

Описание работы: в работе приведено исследование и анализ методов прогнозирования стохастических процессов. Произведена разработка собственного метода прогнозирования, основывающегося на комбинации статистического и нестатистического методов с использованием нейронных сетей. На основе реальных данных показано, каким образом данный метод предсказания может применяться биржей для торговли против прочих игроков в целях максимизации собственной прибыли.