

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой: <https://stuservis.ru/otchet-po-praktike/282575>

Тип работы: Отчет по практике

Предмет: Финансы

Оглавление

ВВЕДЕНИЕ 3

ИССЛЕДОВАНИЕ ПРИРАЩЕНИЙ ЦЕН НА НОРМАЛЬНОСТЬ И НА СТАЦИОНАРНОСТЬ 4

ВВЕДЕНИЕ

Моделирование предстоящих котировок стоимости обширно исследуется в множества сферах познаний, в этом количестве трейдинге, капиталах, статистике и информатике. Главной мишенью моделирования предстоящих котировок стоимости считается приобретение абстрактной доходы. Прогноза стоимости в экономические приборы применяются с целью уменьшения базарного зарубка и повышения прибыльности, и выполняются в базе базарной данных.

Вместе с этапа основы торговли в фондовом торге вплоть до нынешнего этапа размер и вид данных значительно поменялись: на сегодняшний день каждой людей вместе с допуском в линия Сеть интернет способен приобрести терабайты информации, таким образом либо по другому сопряженных вместе с фондовым торгом. С-из-за повышения информативного струи и его быстроты способы, первоначально использовавшиеся с целью торговли, потерпели существенные переустройства.

Кинетика базаров денежных средств исследуется ранее наиболее Сто года, исследование и моделирование стоимости в экономические приборы изображены в крупном числе изучений, ключевыми с каковых считаются деятельность Дж. Литнера, Грамм. Марковица, Буква. Моссина, Дж. Тобина, При. Шарпа, Э. Элтона. В сфере капиталов большая часть классических модификаций моделирования стоимости промоакций применяют статистические модификации и модификации нейронных сетей, наученных в многозначительных информации касательно стоимостях (Park, Irwin, 2007).

ИССЛЕДОВАНИЕ ПРИРАЩЕНИЙ ЦЕН НА НОРМАЛЬНОСТЬ И НА СТАЦИОНАРНОСТЬ

Выделяют два основных подхода к прогнозированию курсов акций: традиционные методы, применяемые инвесторами на фондовом рынке, и математические модели.

В целях краткосрочного и долгосрочного прогнозирования цен на природный газ используют следующие основные типы экономико-математических моделей:

- балансовые модели;
- эконометрические модели, включая экспертные системы;
- стохастические модели.

Изначально проведем исследование приращений цен на:

- нормальность (критерий Колмогорова - Смирнова);

- стационарность (критерий Дарбина - Уотсона).

Таблица 1.

Текущие цены фьючерсных контрактов

Последняя

сделка Изменение

к закрытию Макс.

за день Мин.

за день Объем торгов

(контр.) Число

сделок Открытых

позиций

Фьючерсный контракт на природный газ

NG-1.23

9.056 +4.33% 9.19 8.581 20 20 238

NG-2.23

8.71 +0.58% 8.995 8.71 2 2 52

NG-9.22

9.037 +3.06% 9.084 8.784 33376 16825 32126

NG-10.22

9.092 +3.4% 9.126 8.826 2960 2168 3902

NG-11.22

9.2 +3.37% 9.208 9.018 75 71 738

NG-12.22

9.267 +2.4% 9.353 9.14 28 26 544

-

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой: <https://stuservis.ru/otchet-po-praktike/282575>