

ІНТЕЛЕКТУАЛЬНА СИСТЕМА ПРОГНОЗУВАННЯ ВАЛЮТНОГО РИНКУ

Масік С. О.

Науковий керівник - проф., к.т.н. Месюра В.І.

Невід'ємною ланкою міжнародної валютної системи є валютний ринок. Сучасний валютний ринок - система стійких економічних і організаційних відносин між учасниками міжнародних розрахунків з приводу не тільки валютних операцій, а й зовнішньої торгівлі, надання послуг, здійснення інвестицій та інших видів діяльності.

Технічний аналіз розглядає курси та обсяги трейдингу на основі графічного представлення котирувань валют у часі і спрямований на оцінку тенденції в майбутньому. Він дозволяє передбачати рух курсів валют на основі дослідження даних про минулі курси та обсяги трейдингу.

Той факт, що визначені конфігурації на графіках цін мають властивість повторюватись стало і багаторазово, на різних ринках і в різних масштабах часу, є наслідком об'єктивних законів фізики, економіки і психології. Ті правила, що діяли у минулому, діють й зараз, а також будуть діяти у майбутньому. На цьому і ґрунтуються всі методики прогнозування майбутнього.

Цей тип аналізу покладається на евристичні формули для відстеження тенденцій руху курсів і дозволяє оцінити можливості для продажу або покупки валюти.

Основним завданням системи є визначення оцінок росту і спаду курсу в майбутньому, які допомагають технічному аналітику здійснити прогноз та зробити відповідні висновки. На основі статистичних даних минулих періодів визначається поведінка ринку в майбутньому. Метод ґрунтується на використанні ланцюгів Маркова, що дозволяє з певною точністю визначити ймовірність росту чи спаду курсу валюти.

Основна властивість марківських ймовірностей це пам'ять про попередні переходи. Цю властивість в контексті даної задачі можна сформулювати наступним чином: розподіл ймовірностей $P_t(i, j)$ характеризує ймовірність того, що котирування валюти прийме значення j , за умови, того що віддалене на t кроків (наприклад, t днів) котирування, мало значення i .

Недоліком даного підходу є низька точність оцінок для прогнозування на піках росту та спаду курсу валюти. Перевагою є швидкість здійснення прогнозу, що є дуже важливим для швидкого прийняття рішень.

Дану інтелектуальну систему доцільно використовувати для короткострокових прогнозів, що є актуальним для трейдерів.