Ограничения исследований включают:

* Ограниченный набор данных (количество компаний, временной период, географическое положение).
* Неполнота данных (отсутствие учета макроэкономических факторов, новостей, объемов торгов, транзакционных издержек).
* Специфика моделей (применимость только к определенным типам временных рядов, переобучение на малых выборках, зависимость от точности входных данных).
* Нестабильность внешней среды (изменение экономической ситуации, рыночные колебания, человеческий фактор).
* Вычислительные ограничения (высокая нагрузка, необходимость работы специалистов).
* Зависимость от исторических данных и предположений о стационарности временных рядов.
* Ограниченность применения для долгосрочного прогнозирования.
* Невозможность точного количественного предсказания изменения цен.