



Совместный семинар кафедры теории вероятностей и Фонда "Институт "Вега"

# **Прогнозирование финансовых временных рядов с помощью нейронных сетей с памятью**

Махова Анастасия

Руководитель: М. И. Кумсков, д.ф.-м.н., профессор, зав. лаборатории вычислительных методов  
Механико-математический факультет, МГУ им. М. В. Ломоносова

Москва, 2023



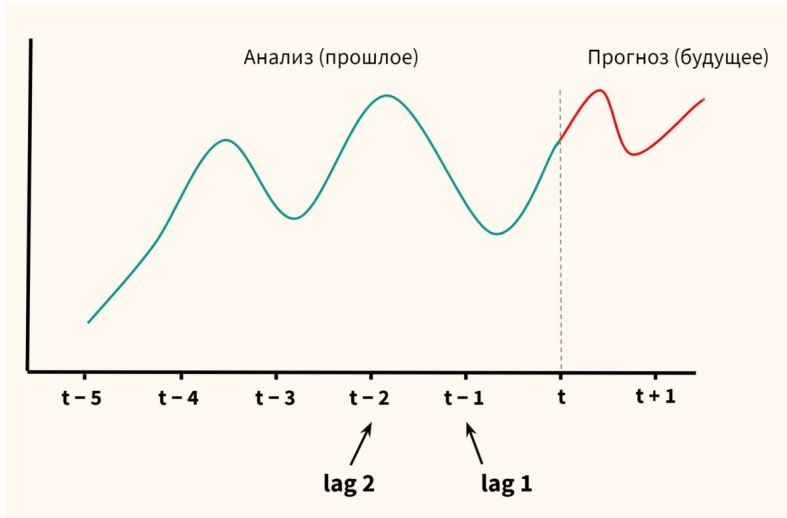
## Постановка задачи

### Задача

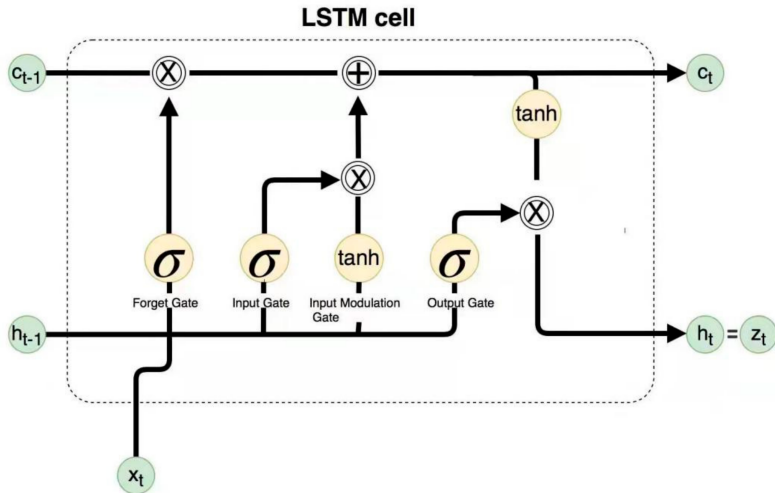
Создать модель для прогноза тренда временного ряда с помощью нейронной сети с памятью (LSTM)

- Ввод: временной ряд  $X = \{X_1, X_2, \dots\}$   
Можно составить прогноз основываясь только на ценах или же добавить к ним значения фундаментальных показателей и технических индикаторов.
- Вывод: вектор со значениями из  $\mathbb{Z}_3$   
Мы решаем задачу классификации, так как тренд бывает трех типов: восходящим, нисходящим и боковым.

# Постановка задачи



# Постановка задачи





# Постановка задачи

подзадачи

- Каким будет прогнозирование: точечным или интервальным?
- Какие слои будут в модели?
- Функция потерь: Categorical Crossentropy (CCE)
- Алгоритм оптимизации: Stochastic Gradient Descent (SGD) / Adaptive Moment Estimation (Adam)
- Метрика для оценки качества модели: Precision/ recall / F-мера



## Постановка задачи

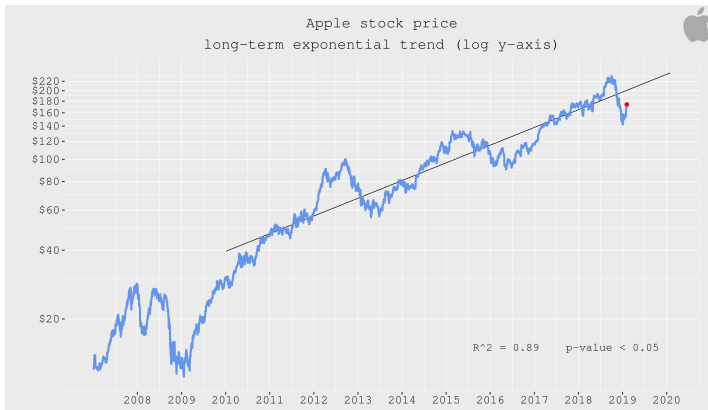
- Язык программирования - Python
- Среда разработки - Google Collab
- Фреймворки - TensorFlow(Keras) и PyTorch



# Постановка задачи

Задача для исследования

Рассмотреть временной ряд на разных тиках





## План работы над исследованием

1. Знакомство с машинным обучением, нейронными сетями, принципом работы LSTM, а так же с экономической частью задачи.
2. Изучение статей на похожие темы.
3. Постановка задачи.
4. Решение задачи.
5. Исследование.
6. Подведение итогов.
7. Защита курсовой работы.





## Обзор литературы

- [1] Jürgen Schmidhuber's page on Recurrent Neural Networks (updated 2017) <https://people.idsia.ch/~juergen/rnn.html> (27.11.2022)
- [2] Sezer, Omer Berat and Gudelek, Mehmet Ugur and Ozbayoglu, Ahmet Murat Financial Time Series Forecasting with Deep Learning : A Systematic Literature Review: 2005-2019  
<https://arxiv.org/pdf/1911.13288.pdf> (27.11.2022)
- [3] Luca Di Persio and Oleksandr Honchar. Recurrent neural networks approach to the financial forecast of google assets. International Journal of Mathematics and Computers in Simulation, 11:713, 2017.
- [4] Николенко С., Кадурин А., Архангельская Е. Глубокое обучение. — СПб.: Питер, 2018

