

Анализ временных рядов.

Аминев Руслан

Мишечкина Виолетта

Реут Виталий

Смирнов Владимир

Для рассмотрения будет взят биржевой курс акций компании Apple за последние девять лет. Причина выбора именно этого показателя отсутствует. Работа, которую мы проводим, имеет ценность исключительно за счет приобретаемого опыта.



Изначально можно заметить, что этот курс характеризуется стабильным ростом на долгосрочных периодах. Однако, динамика на краткосрочных периодах достаточно сложна и непоследовательна.

В качестве инструмента выбран Matlab. Этот продукт обладает богатым набором методов для анализа временных рядов различной природы. Кроме того, он невероятно гибок и позволяет пользователю добавлять свои методы.

План работы:

- 1) Получить данные с ресурса: [google.com/finance](https://www.google.com/finance).
- 2) Экспортировать данные в Matlab.
- 3) Обработать данные, сгладив резкие всплески.
- 4) Выбрать математический инструмент/ы для построения модели процесса.
- 5) Применить выбранные методы к рассматриваемым данным.
- 6) Провести тестирование на периодах различной длины.