

С. Ф. Миксюк,
д-р экон. наук,
БГЭУ (г. Минск)
e-mail: Smiksyuk@mail.ru

Я. А. Собачевская,
магистрант,
БГЭУ (г. Минск)
e-mail: sobachevskaya13@gmail.com

ПОСТРОЕНИЕ МОДЕЛИ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ ЦЕН НА АКЦИИ ГАЗОВОЙ КОМПАНИИ

Прогнозирование цен акций является одной из наиболее актуальных задач, стоящих перед инвесторами и аналитиками, поскольку оно позволяет принимать обоснованные решения, минимизируя риски и увеличивая потенциальную прибыль. В частности, газовая отрасль, как одна из ключевых составляющих мировой экономики, требует особого внимания, так как колебания цен на газ могут оказывать значительное влияние на финансовые результаты компаний, работающих в этом сегменте.

Целью исследования является выявление особенностей методического обеспечения модели прогнозирования цен на акции газовой компании, включая, математический аппарат модели, информационное обеспечение

Анализ литературы [2,3] позволил выделить как традиционные подходы, так и более современные, основанные на алгоритмах машинного обучения. Традиционные методы, такие как линейная регрессия и временные ряды, имеют свою ценность и показывают свою эффективность при прогнозировании цен на акции в случае выявленных факторов влияния на цены акции и их закономерностей. Что касается алгоритмов машинного обучения, таких как нейронные сети, деревья решений и ансамблевые методы, то они демонстрируют свою эффективность в условиях скрытых и невыявленных закономерностей.

Показано[1], что цены акций газовой компании подвержены влиянию различных факторов. Их можно условно разделить на две группы: количественно измеряемые и качественные.

К первой группе мы отнесли такие факторы как цена на газ и нефть, дивидентная доходность, темп роста экономической активности, уровень ключевой ставки как альтернатива цен на акции, объемы производства. Ко второй группе – геополитическая обстановка, погодные условия, степень акционерной стоимости компании.

Для анализа чистого влияния количественно измеряемых факторов на цены акций нами предполагается построение моделей временных рядов. Чтобы оценить трендовые тенденции цен на акции с учетом совокупности влияния всего набора факторов предполагается построение моделей искусственного интеллекта.

Список использованных источников

1. Вакин А.Н., Пицуха А. В. Анализ состояния и факторов, влияющих на стоимость акций нефтегазовых компаний. Научные записки молодых исследователей 2020; 8(2). – 34–44 с.
2. Бенгина Т. А., Сковородин А. С. Математические методы анализа на фондовом рынке и прогнозирование движения цен на акции и другие финансовые инструменты //Символ науки. – 2020. – № 5. – С. 10.
3. Агнон Х. О. Прогнозирование цены акций с использованием машинного обучения [Электронный ресурс] / Х. О. Агнон // Инновационная наука. – 2021. – № 6. – Режим доступа: <https://cyberleninka.ru/article/n/prognozirovanie-tseny-aktsiy-s-ispolzovaniem-mashinnogo-obucheniya>. – Дата доступа: 10.12.2024.