

АДАПТИВНЫЕ МОДЕЛИ МУЛЬТИТРЕНДОВЫХ ПРОЦЕССОВ И ПРОГНОЗ СТОИМОСТИ ФИНАНСОВЫХ АКТИВОВ

Давнис В. В., Тинякова В. И.

Для прогнозирования стоимости финансовых активов предлагается модель с многоуровневой структурой адаптивного механизма. Модель наделена новым свойством, в соответствии с которым сигналы обратной связи не только могут усиливаться или ослабляться, но и восприниматься с противоположным знаком. Благодаря этому свойству удастся предсказывать развороты краткосрочного тренда, что повышает практическую ценность модели.