

O pewnej metodzie prognozowania wartości instrumentów finansowych

Głównym problemem w prognozowaniu jest wyznaczenie przewidywanej wartości szeregu czasowego poza przedziałem czasowym, w którym ten szereg jest określony. Prognoza szeregów czasowych obliczona dowolną metodą prognozowania jest tym lepsza, im różnica pomiędzy jej wartością a rzeczywistymi danymi w przyszłości jest mniejsza; gdy mierniki dokładności predykcji mają mniejsze wartości.

W referacie zostanie przedstawiona jedna ze stochastycznych metod prognozowania — metoda autokowariancji. Ta metoda zostanie zastosowana do prognozowania wartości instrumentów finansowych.

Zagadnienie prognozowania wartości instrumentów finansowych jest zagadnieniem istotnym dla inwestora, gdyż znajomość prognozowanej wartości instrumentu finansowego wpływa w znaczący sposób na decyzje inwestycyjne, z którymi związana jest przyszła wartość portfela inwestycyjnego i z tym związany zysk.