Результат интеллектуальной деятельности

в виде программы для ЭВМ

**«АВТОМАТИЗИРОВАННАЯ СТРАТЕГИЯ ДЛЯ УПРАВЛЕНИЯ ФИНАНСОВЫМИ АКТИВАМИ НА ОСНОВЕ МОДЕЛЕЙ ГРАДИЕНТНОГО БУСТИНГА»**

разработан в рамках научно-исследовательской работы по теме:

«Разработка методологии автоматизированного мониторинга удовлетворенности граждан качеством предоставления государственных и муниципальных услуг в многофункциональных центрах на основе анализа данных видеонаблюдения методами машинного обучения» (ВТК-ГЗ-ПИ-32-19) в рамках

государственного задания на 2019 год

Сведения об авторах:

**Соловьев Владимир Игоревич** д.э.н., профессор, Руководитель департамента

Анализа данных, принятия решений и финансовых технологий

**Титов Никита Алексеевич** выпускник Факультета прикладной математики и информационных технологий

Контакты:

VSoloviev@fa.ru

**РЕКЛАМНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОПИСАНИЕ**

Программа прогнозирует наилучшие в смысле максимизации прибыли моменты открытия и закрытия длинных позиций на финансовом рынке. Математическая модель программы основана на методе машинного обучения, называемом градиентным бустингом над решающими деревьями, и его высокоэффективной программной реализации LightGBM. Настройка программы, то есть ее обучение, производится на наборе размеченных экспертом в области биржевой торговли данных о состоянии рынка финансовых инструментов (тренд или флет) в различные периоды времени.

Программа является универсальной: после вышеописанной процедуры соответствующей настройки она способна работать с любым рынком, финансовым инструментом и временным периодом, для которого доступны стандартные данные о ценах (максимальные и минимальные дневные цены, а также открытия и закрытия) и объемах торгов.

Пользователями программы могут быть трейдеры, брокеры, финансовые аналитики, индивидуальные инвесторы и другие участники финансового рынка.