

Прогнозирование валютных курсов в деятельности технологического предпринимателя

Бойко Андрей,
аспирант кафедры ИБМ-7
(«Инновационное
предпринимательство»)

Предпринимательская деятельность - ЭТО

«...самостоятельная, осуществляемая на свой риск деятельность, направленная на систематическое получение прибыли от пользования имуществом, продажи товаров, выполнения работ или оказания услуг...»
(ГК РФ. Статья 2)

Основные сферы предпринимательства:

- › общее предпринимательство
- › социальное предпринимательство
- › технологическое предпринимательство

Технологическое предпринимательство - ЭТО

«...систематическая предпринимательская деятельность, основанная на трансформации фундаментальных научных знаний в промышленно применимые, экономически оправданные и востребованные рынком технологии» (Барыкин А.Н., Икрянников В.О., 2010)

Большинство технологических стартапов реализуют проекты в сфере IT

Основные затраты IT-стартапов связаны с:

- › приобретением средств вычислительной техники
- › приобретением неисключительных лицензий на использование программного обеспечения:
 - › общесистемного (ОПО – операционные системы)
 - › специального (СПО – интегрированные среды разработки)

Актуальность прогнозирования валютных курсов в деятельности технологического предпринимателя

- › приобретение аппаратного и программного обеспечения
- › участие иностранных инвесторов в формировании венчурного капитала
- › выход предпринимателя на международный рынок

Основные компетенции технологического предпринимателя, необходимые для прогнозирования валютных курсов

› знания:

- › математическая статистика
- › теория временных рядов

› навыки:

- › программирование (ex. MATLAB)

› умение использовать эконометрические пакеты:

- › Statistica
- › Stata
- › EViews
- › R Studio
- › MS Excel

Классификация прогнозов валютного курса в зависимости от длительности периода упреждения

- › краткосрочный прогноз
- › среднесрочный прогноз
- › долгосрочный прогноз

Применимость моделей в зависимости от длительности периода упреждения

Метод	Краткосрочный прогноз	Среднесрочный прогноз	Долгосрочный прогноз
АРПСС	+	+/-	-
Экспоненциальное сглаживание	+/-	+	-
Регрессия	+/-	+/-	+
Нейронные сети	+	+	+

Этапы построения модели прогнозирования

А

- выбор типа модели

Б

- оценка параметров модели

В

- проверка адекватности модели

Г

- прогнозирование будущих значений

Пример прогнозирования валютного курса

- › [SEE_2016\html\forecast.html](#)
- › [SEE_2016\forecast.pdf](#)

π

Спасибо за внимание!