

24 ביולי 2017

מיומנו של אקטואר: חיזוי רשת עצבית (Neural Network Forecasting)

המונח רשת עצבית (Neural Network) לעיתים קרובות מתייחס לרשת או למעגל של נוירונים ביולוגיים, בעוד ששימוש מודרני של המונח מתייחס לרשת עצבית מלאכותית (ANN-Artificial) המורכבת נוירונים מלאכותיים, או מצמתים, הנוצרים מחדש בסביבת תוכנה. רשתות שכאלה מנסות לחקות את הנוירונים במוח האדם בדרכי החשיבה וזיהוי הדפוסים, ובמקרה שלנו דגן, זיהוי דפוסים למטרות חיזוי נתוני סדרה עתית. נציין כי מספר השכבות המוסתרות ברשת הינו פרמטר תשומה ויש לכייל אותו באמצעות הנתונים. ברגיל, ככל שדפוס הנתונים מסובך יותר, כך מספר השכבות המוסתרות שיהיה עליך לחשב יהיה גדול יותר וכמובן שהזמן שייקח לך לחשב אותן יהיה ארוך יותר. מומלץ להתחיל עם 3 שכבות. תקופת הבדיקה הינה מספרן של נקודות הנתונים המשמש בכיול הסופי של מודל הרשת העצבית ועל כן מומלץ להשתמש לפחות באותו מספר תקופות שאותו אנו מבקשים לחזות כתקופת הבדיקה.

בכבוד רב,


יועץ פולניצר

יו"ר ומנכ"ל לשכת מעריכי השווי והאקטוארים הפיננסיים בישראל

 WWW.IAVFA.ORG



ת.ד. 57334, תל אביב, 6157301

 077-5070590  153-77-5070590  IAVFA1020@GMAIL.COM