

РЕФЕРАТ

Магістерська дисертація: 87 с., 25 рис., 2 додатка, 25 джерел.

Магістерська дисертація присвячена аналізу ефекту інформаційного простору на коливання курсу обміну валют неофіційного валютного ринку в Україні. Був проведений глибинний аналіз фінансового ринку валют в Україні, в ході якого досліджувався ефект діяльності НБУ, особливо валютних обмежень, на динаміку курсу обміну валют на чорному ринку.

Розроблено програмний продукт на мові Python для отримання даних із неофіційного валютного ринку, та на мові R для аналізу та моделювання динаміки валютного курсу. Виявлені залежності підтверджують гіпотезу про вплив інформаційного простору на коливання валютного курсу. Також, було виявлено неефективності ринку, що можуть бути використані на практиці.

Результати проаналізовано та було візуалізовано за допомогою ядерних функцій розподілу і таблиць.

Новизна даної роботи в застосуванні соціо-економічних факторів при моделюванні динаміки валютного курсу чорного ринку в Україні.

В подальшому рекомендується використовувати також дані з депозитних рахунків в комерційних банках, застосовувати нейронні мережі при моделюванні.

ЧОРНИЙ РИНОК, МОДЕЛЮВАННЯ, МЕТОД ARIMA, МЕТОДОЛОГІЯ БОКСА - ДЖЕНКІНСА, МОДЕЛЬ ВОЛАТИЛЬНОСТІ, БАЙЄСІВСЬКИЙ ПІДХІД