

Дипломна робота: 110 с., 28 рис., 12 табл., 3 додатки, 12 джерел.

Предметною областю дослідження є фінансово-економічні процеси.

Об'єктом дослідження є глобальний фондовий ринок.

Предметом дослідження є індекси локальних фондових ринків та їх взаємозв'язок, динаміка та еволюція фонового ринку.

Методами дослідження є метод головних компонент, кластерний, факторний та кореляційний аналіз. Мета дослідження: зменшення розмірності для задач аналізу фінансових часових рядів.

Теоретичною та методологічною основою дослідження є праці вітчизняних і зарубіжних вчених в галузі економічної теорії, математичного моделювання, прогнозних моделей, кореляційного та кластерного аналізу.

В ході дипломної роботи створено програмний продукт для виділення головних компонент з деякого набору фондових індексів.

Методологія реалізована на основі уже відомих алгоритмів та з використанням власних розробок.

Програмний продукт реалізовано за допомогою мови програмування VBA.

ФОНДОВІ ІНДЕКСИ, ФОНДОВИЙ РИНОК, ЗАЛЕЖНІСТЬ,
КОРЕЛЯЦІЯ, КЛАСТЕР