

## РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 79 с., 19 рис., 6 табл., 2 дод., 16 джерел.

МОДЕЛЮВАННЯ, ПРОГНОЗУВАННЯ, ВАЛЮТНИЙ КУРС, АВТОРЕГРЕСІЯ, ВАЛЮТНА БІРЖА, МЕТОД ГРУПОВОГО ВРАХУВАННЯ АРГУМЕНТІВ.

В роботі досліджується проблема аналізу, моделювання та прогнозування курсу валют на Українській міжбанківській валютній біржі. В роботі наведено огляд основних та найефективніших моделей і методів – авторегресії (АР) та її модифікацій, методу групового врахування аргументів. Розглянуто метод МНК для обчислення коефіцієнтів АР моделей та принцип визначення порядку АР моделей, застосовуючи значення автокореляційних та частково автокореляційних функцій. Було проведено необхідні експерименти та порівняно їх результати.

Об'єкт дослідження: Статистичні дані щодо фінансово-економічних процесів, які описуються часовими рядами та потребують ефективної аналітичної обробки з метою виявлення практично корисних знань та взаємозв'язків між ними, необхідних для прийняття рішень на Українській міжбанківській валютній біржі.

Предмет дослідження: Методи регресійного аналізу.

Мета роботи: Моделювання та прогнозування динаміки валютного курсу на Українській міжбанківській валютній біржі.

Методи дослідження та апаратура: Математична статистика, методи регресійного аналізу, ноутбук, який працює на операційній системі Windows 10.

Результати: Побудовані моделі АР, АРКС, МГВА для прогнозування курсу валютної пари USD/UAH на Українській міжбанківській валютній біржі, виконаний прогноз на 4 місяці.

Галузь використання: Прогноз курсу валют на валютній біржі.