

## РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 114 ст, 7 табл., 21 рис., 3 дод. та 17 джерел.

РИНКОВИЙ РИЗИК, ЗНАЧЕННЯ ПІД РИЗИКОМ, УМОВНЕ  
ЗНАЧЕННЯ ПІД РИЗИКОМ, ОЧІКУВАНИЙ ДЕФІЦИТ, УАРУГ

Тема: Система підтримки прийняття рішень для аналізу ринкових фінансових ризиків

В роботі розглянуто проблему оцінки та аналізу ринкового фінансового ризику із використанням методологій VaR та CVaR та створена відповідна система підтримки прийняття рішень.

Об'єкт дослідження: система підтримки прийняття рішень для аналізу ринкових фінансових ризиків.

Предмет дослідження: комплексний підхід до управління ринковим ризиком з використанням методологій VaR та CVaR та демонстрація їх роботи на статистичних даних.

Мета роботи: підвищення точності оцінки ринкового ризику за рахунок розробки стратегії, що дозволяє наочно бачити ситуацію на фондовому ринку, а також аналізувати поточні та попередні дані та виконувати прогнозування на основі історичних даних.

Методи дослідження: методи статистичного аналізу даних з використанням вартісних мір ризику.

В роботі наведено результати аналізу статистичних даних виробничого процесу за допомогою методологій VaR та CVaR. Розроблено програмний продукт, призначений для оцінки та аналізу ринкового ризику.

Для аналізу і прогнозування використані реальні дані Лондонської фондової біржі, а саме ціни 63 ЦП, що входять до складу індексу Футсі (FTSE 100), за останні три роки.