

## АНОТАЦІЯ

Магістерська дисертація: 100 с., 18 рис., 12 табл., 2 додатки, 19 джерел.

Предметною областю дослідження є фінансово-економічні процеси.

Об'єктом дослідження є глобальний фінансовий ринок.

Предметом дослідження є похідні інструменти фінансових ринків та їх взаємозв'язок, динаміка та еволюція фінансового ринку.

Методами дослідження є метод головних компонент, кластерний, факторний та кореляційний аналіз. Мета дослідження: зменшення розмірності для задач аналізу фінансових часових рядів, створення алгоритму для оцінки, диверсифікації ризиків при портфельному інвестуванні.

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, ФІНАНСОВИЙ РИНОК, АКТИВ, ФОНДОВИЙ РИНОК, ЗАЛЕЖНІСТЬ, КОРЕЛЯЦІЯ, КЛАСТЕР, Ф'ЮЧЕРС, ДЕРИВАТИ, ПОРТФЕЛЬНЕ ІНВЕСТУВАННЯ**