

УДК 336.761.3

## **АНАЛІЗ І ПРОГНОЗУВАННЯ ІНДЕКСІВ НА ФОНДОВИХ РИНКАХ**

**Співаков О.Г.**

**Науковий керівник – доц. каф. «Економічної кібернетики та інформаційних технологій», канд. екон. наук Андрієнко В.М**

Розвиток фондового ринку є однією з цілей макроекономічної політики уряду в будь-якій країні світу. Фондові ринки грають істотну роль у розвитку сучасної економіки.

Метою магістерського дослідження визначити метод прогнозування фондового індексу України ПФТС, провести експериментальні розрахунки та їх аналіз.

Протягом багатьох років моделювання показників фондового ринку здійснювалося на основі ймовірно - статистичних методів. В даний час вчені переконалися в тому, що для показників фондового ринку не виконуються передумови цих методів. А саме, емпіричні дані залежні між собою.

Останнім часом серед дослідників став популярним метод моделювання за допомогою нейронних мереж. Нейронні мережі – виключно потужний метод моделювання, який дозволяє відтворювати надзвичайно складні залежності [1].

Емпіричні дані по фондовому індексу ПФТС і біржовим активам характерна залежність між спостереженнями. Здібності нейронної мережі до прогнозування безпосередньо впливають з її здатності до узагальнення і виділення прихованих залежностей між вхідними і вихідними даними. Таким чином, обраний спосіб відповідає властивостям прогнозованого показника і дає хороший прогноз.

1. Хайкин С. Нейронные сети: полный курс, 2-е изд., испр./ Хайкин С. Пер. с англ. – М.: ООО “И.Д. Вильямс“, 2006. - 1104 с./ Под ред. д.т.н. Н.Н. Куусуль.