

# **ВИБІР ОПТИМАЛЬНОЇ СТРАТЕГІЇ ОПЕРУВАННЯ ЦІННИМИ ПАПЕРАМИ МЕТОДАМИ ІМІТАЦІЙНОГО МОДЕЛЮВАННЯ**

**Данилейко Ю.С.**

**Науковий керівник – проф. каф. «Прикладна математика», канд. екон. наук**

**Юхименко Б. І.**

Цінні папери — це грошові документи, що засвідчують право володіння або відносини позики між особою, яка їх випустила, та їх власником і передбачають, як правило, виплату доходу у вигляді дивідендів або процентів, а також можливість передання грошових та інших прав, що випливають із цих документів, іншим особам. В теперішні часи цінні папери отримали широкого розповсюдження у практиці підприємств.

Цілями операцій з цінними паперами являються: формування та примноження капіталу; отримання грошових доходів від операцій з цінними паперами; отримання прибутку від інвестицій у фондові інструменти; приймання участі в уставному капіталі акціонерного товариства для контролю над власністю; використання цінних паперів в якості залогу.

Власники цінних паперів повинні аналізувати специфіку здійснення окремих видів операцій з цінними паперами та вирішувати проблеми що з'являються в силу ряду причин (політичних, економічних, законодавчих, організаційних) при їх проведенні. Вони мають оцінювати якість цінних паперів на вітчизняному ринку, освоювати алгоритми оцінки ситуацій та прийняття рішень, технології проведення операцій.

Визначати стратегію поведінки при оперуванні цінними паперами – це значить визначати коли треба купувати цінні папери, а коли їх продавати, коли зберігати.

Існують певні сталі ситуації при оперуванні цінними паперами, однак при зміні різноманітних ситуацій відомі прийоми не завжди вигідні. Тому постає питання, яким чином треба було б поступити, щоб досягти певного ефекту. Для цього можна використовувати математичні методи. Вони будуть реалізовані за допомогою імітаційного моделювання, так як в теперішній час імітаційне моделювання - найбільш ефективний метод дослідження систем.

Імітаційне моделювання може використовуватися для вирішення всіх сформульованих вище задач, більш точно повторюючи реальний процес, та дозволяє детально моделювати складові ринку цінних паперів.

В даній роботі пропонується модель, імітуюча поведінку цін на цінні папери, яка використовується для прогнозування ситуацій, що з'являються, які повинні зумовлювати стратегії поведінки.