

КОЛИВАННЯ ОСНОВНИХ КУРСІВ ВАЛЮТ НА РИНКУ УКРАЇНИ

Ширяєва Н.В., Макаренко А.Б.

Національний технічний університет

«Харківський політехнічний інститут», м. Харків

Різкі коливання курсу на валютному ринку України негативно впливають на фінансове середовище та викликають ірраціональну поведінку учасників ринку. Цінова динаміка перебуває під пильною увагою практиків, та вчені намагаються розробити достовірні теорії, що пояснюють і прогнозують поведінку біржових характеристик. Тому дослідження факторів впливу на коливання найпоширеніших валютних пар долар-гривня та долар-євро і прогнозування зміни курсу є надзвичайно актуальними питаннями.

Дослідження наукової літератури [1] показало, що використання валютного індексу як співвідношення ринкового (офіційного) валютного курсу та паритету купівельної спроможності набуває поширення. Крім того, в роботі [2] продемонстровано можливості застосування теорії детермінованого хаосу до моделювання фінансового ринку. Але бракує досліджень факторів впливу на коливання курсів на валютному ринку України.

На рисунку 1 представлено графік коливання значимої іноземної валюти по всьому світу. Бачимо стрімкий ріст у 2008 та 2014 рр, який продовжував також своє зростання у 2015 році. Вочевидь існують причини, що спричиняють такі коливання.

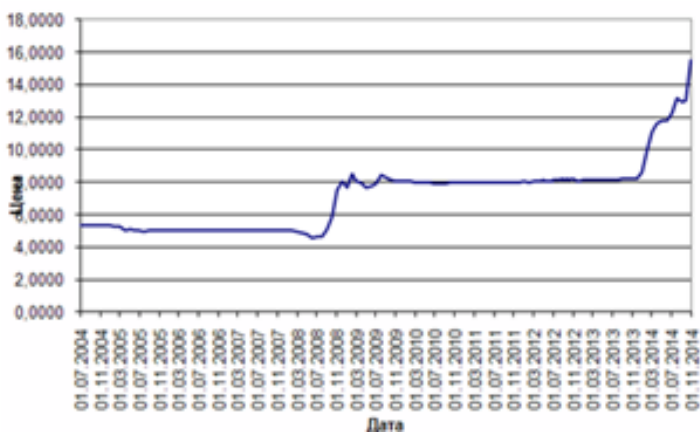


Рисунок 1 – Коливання пари долар-гривня з 2004 по 2014 рр.

Отже, в роботі розглянуто деякі причини коливань за допомогою обробки статистичних даних по валютним парам із застосуванням математичного моделювання. Зроблені висновки сприятимуть розробці математичної моделі прогнозування подальших змін курсу.

Література:

1. Задоя А.А. Валютный индекс и внешнеэкономическая деятельность // А.А. Задоя. Научно-практический журнал «Академічний огляд. Економіка та підприємство», № 1 (34). – Дніпропетровськ, 2011. – С. 107-115.