

РЕФЕРАТ

Кваліфікаційна робота магістра містить три розділи, 99 с., 45 рис., 30 табл., 20 формул, 4 додатки, 72 джерела.

Об'єкт дослідження — динаміка фінансових інструментів на фондовому ринку.

Предмет дослідження — моделі та методи порівняльного аналізу динаміки фінансових інструментів на фондовому ринку.

Мета роботи — удосконалення та застосування комплексного методу порівняльного аналізу часових рядів фінансових інструментів на фондовому ринку, що враховує їх нелінійну динаміку.

Методи дослідження — загальні: аналіз, порівняння, узагальнення; спеціальні: методи статистичного аналізу, тести на детермінований хаос, комплексного фрактального аналізу, нечітке моделювання (реалізовано в програмному продукті MATLAB).

У роботі досліджено роль та значення фондового ринку з точки зору інвестиційної діяльності, визначені особливості його сегментів та фінансових інструментів на них. Проаналізовано можливості застосування методів статистичного аналізу та особливості методів фрактального аналізу для характеристики динаміки економічних показників. Сформовано систему показників для характеристики динаміки фінансових інструментів як базу для розробки методу порівняльного аналізу та розраховано її для обраних сегментів фінансового ринку. Удосконалено та застосовано методику порівняльного аналізу динаміки фінансових інструментів на фондовому ринку сегменту ІТ-галузі та індустрії розваг за рахунок порівняння характеристик нечіткої глибини пам'яті часових рядів. Проаналізовано результати та розроблено рекомендації щодо їх практичного застосування.

ФОНДОВИЙ РИНОК, ФІНАНСОВІ ІНСТРУМЕНТИ, АКЦІЇ, APPLE, TESLA, ALPHABET, DISNEY, NETFLIX, SONY, ЧАСОВИЙ РЯД

SUMMARY

Master's qualification work consists of three sections, 99 p., 45 figures, 30 tables, 20 formulas, 4 annexes, 72 sources.

The object of the study is the dynamics of financial instruments in the stock market.

The subject of the work is the models and methods of comparative analysis of the dynamics of financial instruments in the stock market.

The purpose of the study is the improvement and application of a comprehensive method of comparative analysis of time series of financial instruments in the stock market taking their nonlinear dynamics.

Research methods are comparative, statistical analysis, tests for deterministic chaos, complex fractal analysis, fuzzy modeling (implemented in the MATLAB software product).

The role and significance of the stock market from the point of view of investment activity are investigated in the work, features of its segments and financial instruments on them are defined. Possibilities of application of methods of statistical analysis and features of methods of fractal analysis for the characteristic of dynamics of economic indicators are analyzed. A system of indicators to characterize the dynamics of financial instruments as a basis for developing a method of comparative analysis and calculated it for selected segments of the financial market. The method of comparative analysis of the dynamics of financial instruments in the stock market of the segment of the IT industry and the entertainment industry by improving the characteristics of the fuzzy depth of memory of time series has been improved and applied. The results are analyzed and recommendations for their practical application are developed.

STOCK MARKET, FINANCIAL INSTRUMENTS, STOCKS, APPLE, TESLA, ALPHABET, DISNEY, NETFLIX, SONY, TIME SERIES