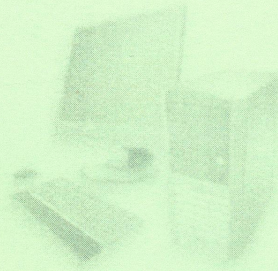


Міністерство освіти і науки, молоді та спорту України
Інститут кібернетики
імені В. М. Глушкова НАН України
Луганський національний університет
імені Тараса Шевченка
Донецький національний технічний університет
Донецький національний університет

МАТЕРІАЛИ

V Всеукраїнської науково-практичної конференції
7-9 квітня 2011 р,

СУЧАСНІ ТЕНДЕНЦІЇ
РОЗВИТКУ ІНФОРМАЦІЙНИХ
ТЕХНОЛОГІЙ В НАУЦІ,
ОСВІТІ ТА ЕКОНОМІЦІ
(Том 1)



м.Луганськ, ЛНУ ім. Т.Шевченка

Іє О. М., Онопченко С. В. Моделювання взаємозв'язків фінансово-економічних показників.....	129
Коркуна Н. М. Математичне моделювання динаміки прямих і непрямих податкових надходжень до бюджету України.....	133
Лисенко О. А. Деякі методологічні аспекти бізнес-моделювання.....	136
Петрусь Н. Б. Регіональні інвестиційні форуми як механізм залучення інвестицій в економіку України.....	139
Плугатаренко К. О., Іє О. М., Часовська Л. І. Статистичні методи дослідження динаміки валютних курсів	141
Рябушенко А. В., Богущ К. В. Моделювання структурних зламів на фондовому ринку України латентною моделлю Маркова	143
Самовилова Н. А. Новые информационные технологии в банковской сфере.....	146
Скороход Н. Н., Заика И. П., Авдеев И. А. Информационно-технологическое обеспечение практической апробации содержания курса макроэкономики ...	148
Хміль Н. А., Ворона А. В. Разработка модели бизнес-процесса сбыта ветеринарных препаратов.....	152
Цыганкова С. А, Заика О. А. Подходы к созданию репозитария экономической направленности для информационного обеспечения научной и педагогической деятельности преподавателей и студентов	154

УДК 311.02

СТАТИСТИЧНІ МЕТОДИ ДОСЛІДЖЕННЯ ДИНАМІКИ ВАЛЮТНИХ КУРСІВ

Плугатаренко К.О., Іє О.М., Онопченко С.В.

Луганський національний університет імені Тараса Шевченка

У статистичній практиці доводиться мати справу з великою кількістю чисел, що характеризують зміну валютних курсів у часі. Для кращого розуміння та аналізу валютних курсів їх потрібно систематизувати, побудувавши хронологічні ряди, які називають рядами динаміки. Вони характеризують закономірності й особливості зміни валютних курсів у динаміці.

З метою дослідження валютних курсів у динаміці вивчають їх попередній розвиток, виявляють динаміку та розраховують середній рівень, аналізують тенденцію руху валютних курсів, прогнозують зміну валютних курсів у майбутньому (на близьку й далеку перспективи).

На динаміку валютного курсу роблять вплив різного роду чинники, які підрозділяються на кон'юнктурні і довгострокові. Відмітимо деякі з них.

На співвідношення попиту і пропозиції на валюту, тобто на динаміку її курсу систематично впливають довготривалі економічні тенденції. По-перше на динаміку валютного курсу цієї країни визначальний вплив робить конкурентоспроможність її товарів на світових ринках, зміна якої кінець кінцем обумовлена рівнем техніки і технології її виробництва.

По-друге, на рівень валютного курсу національної грошової одиниці цієї країни сильно впливає інфляція, яка є віддзеркаленням диспропорції між грошовою масою і товарною пропозицією, що складається в країні в ході розвитку макроекономічних процесів.

По-третє, рівень валютного курсу тісно пов'язаний із станом національного фінансового ринку.

На коливання валютних курсів різних національних грошових одиниць робить вплив і держава. Якщо вона

проводить політику стимулювання експорту, то її результатом може стати позитивне сальдо платіжного балансу країни що неминуче позначиться на підвищенні обмінного курсу національної валюти цієї держави.

У протилежному напрямі діятиме державна політика неадекватного збільшення бюджетних витрат і грошової маси у зверненні країни. В цьому випадку станеться зростання дефіциту платіжного балансу, зменшення резервів іноземних засобів і це кінець кінцем приведе до здешевлення національної валюти цієї держави.

Окрім довготривалих економічних чинників на коливання валютних курсів чинять дію багато кон'юнктурних чинників, пов'язаних з політичною ситуацією в країні. У поєднанні з політичними чинниками на коливання валютних курсів чинять істотну дію війни, стихійні лиха, великі соціальні конфлікти і революції та багато інших чинників.

Для вивчення динаміки валютних курсів використовують такі показники, як абсолютний приріст, темп зростання, темп приросту, середній абсолютний приріст та ін.

Важливим завданням статистичного аналізу валютного курсу, яке має практичне значення, є вивчення й дослідження загальної тенденції динаміки валютного курсу та її особливостей в окремі періоди часу. В багатьох випадках тенденція валютного курсу простежується досить виразно, що видно в таблицях і на графіках, а в інших випадках тенденція може бути прихована за випадковими коливаннями рівнів ряду. Тому перед виявленням загальної тенденції потрібно здійснити аналіз випадковості руху валютних курсів за допомогою ряду статистичних методів, тобто *критеріїв випадковості*. До них відносять критерій поворотних точок, критерій розподілу довжин фаз, критерій, що ґрунтується на ранговій кореляції тощо.

Поворотними точками називають значення ряду, які можуть бути більшими від двох сусідніх (попередньої та наступної (піки, підйоми) або меншими («ями», спади)).

Критерій розподілу довжин фаз полягає в порівнянні теоретичного розподілу довжин фаз випадкового ряду з фактичним.

У статистичній практиці виявлення основної тенденції розвитку явищ у часі проводять методом укрупнення інтервалів, рухомої середньої та аналітичного вирівнювання.

Найбільш ефективним і складним способом виявлення основної тенденції є *аналітичне вирівнювання*.

На практиці найпоширенішими формулами, які виражають тенденцію розвитку (тренд) явищ, є пряма, показникові функція, парабола другого і третього порядків, гіпербола, логістична функція, експонента, ряд Фур'є та деякі інші.

Були розглянуті показники, що допомагають дослідити динаміку валютних курсів, усунути деякі чинники, що впливають на динаміку та істотно погіршують дослідження та аналіз. Розглянуто групи чинників, що впливають на формування валютного курсу країни.

Література

- 1. Ткач Є.І.** Фінансово-банківська статистика: практикум. Навчальний посібник для економічних спеціальностей ВНЗ/Є.І. Ткач. – К.: Либідь, 2003.
- 2. Миклашевская Н.А.** Международная экономика/Н.А. Миклашевская. – М.: Дело и сервис, 2005.
- 3. Бурцева С.А.** Статистика финансов/С.А. Бурцева. – М.: Наука, 2004.
- 4. Елисеєва И.И.** Практикум по макроэкономической статистике/И.И. Елисеєва, С.А. Силаева, А.Н. Щирина. – М.: Наука, 2007.
- 5. Елисеєва И.И.** Общая теория статистики: Учебник для ВУЗов/И.И. Елисеєва. – М.: Финансы и статистика, 2004.