

МІНІСТЕРСТВО
ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ



Харківський
національний
університет
імені В. Н. Каразіна

ВСЕУКРАЇНСЬКЕ ГРОМАДСЬКЕ ОБ'ЄДНАННЯ
"УКРАЇНСЬКА АСОЦІАЦІЯ
ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ"

XIV Всеукраїнська науково-методична
конференція

ПРОБЛЕМИ ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ

**ТЕЗИ КОНФЕРЕНЦІЇ
8-9 жовтня 2009 року**

Харків — 2009

МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ
УКРАЇНИ

НАЦІОНАЛЬНА
АКАДЕМІЯ НАУК
УКРАЇНИ

*Харківський національний
університет імені В.Н.Каразіна
Київський національний
університет
імені Тараса Шевченка
Донецький національний університет
Харківський національний
економічний університет
Харківський національний
технічний університет «ХП»*

*Підкомісія економічної
кібернетики науково-
методичної комісії
Міністерства освіти і
науки України*

*Інститут економіки і
прогнозування
Інститут економіки
промисловості
Науково-
дослідницький центр
індустріальних
проблем розвитку*

ВСЕУКРАЇНСЬКЕ ГРОМАДСЬКЕ ОБ'ЄДНАННЯ
“УКРАЇНСЬКА АСОЦІАЦІЯ ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ”

Міжнародний науково-навчальний центр інформаційних технологій та систем

*ЮНЕСКО/МПП НАН України та Міністерства освіти і науки України
Рада по вивченню продуктивних сил України*

ПРОБЛЕМИ ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ

XIV Всеукраїнська науково-методична
конференція
8-9 жовтня 2009 р.

ТЕЗИ ДОПОВІДЕЙ

Харків 2009

УДК 330.46(063)

ББК 65в635я431

Т 29

Т 29 **Проблеми економічної кібернетики: Тези доповідей XIV Всеукраїнської науково-методичної конференції (8-9 жовтня 2009 р. м. Харків).** – Харьков.: ХНУ імені В.Н. Каразіна, 2009. – 295 с.

У збірнику наведено тези доповідей вчених українських та зарубіжних вищих навчальних та наукових закладів. Доповіді висвітлюють традиційні та нові напрямки сучасної економічної кібернетики, а також проблеми перспективи економіко-математичної освіти: економетричні моделі та методи прогнозування; моделювання нелінійної економічної динаміки; еконофізика; прикладні моделі економічних систем; моделювання економічного ризику; інформаційні технології та системи підтримки прийняття управлінських рішень; проблеми підготовки фахівців з економічної кібернетики; сучасні технології навчання.

Збірник призначений для науковців, викладачів, фахівців з управління економікою, студентів та аспірантів.

Матеріали подаються в авторській редакції. Відповідальність за достовірність інформації, коректність математичних викладок та точність наведених фактів несуть автори.

Рекомендовано до друку вченою радою економічного факультету. Протокол № 8 від 18.09.2009 р.

ISBN 978-966-623-610-7

© Харківський національний університет
імені В.Н. Каразіна, 2009

В роботі розглядаються приклади застосування вище наведеного алгоритму, який ми назвали Фур'є-продовженням часових рядів, до економічних індексів та курсів валют.

Література:

1. Soloviev V., Saptsin V., Chabanenko D. Prediction of financial time series with the technology of high-order Markov chains // Working Group on Physics of Socio-economic Systems (AGSOE).-Dresden, 2009: <http://www.dpg-verhandlungen.de/2009/dresden/agsoe.pdf>.

Соловійов В. М., д.ф.-м.н.,

Черкаський національний університет ім. Б.Хмельницького,

Ганчук А. А., к.е.н.,

Міністерство фінансів України

ЕКОНОФІЗИЧНІ ІНДИКАТОРИ-ПЕРЕДВІСНИКИ РАНЬОГО ПОПЕРЕДЖЕННЯ КРИЗОВИХ ЯВИЩ

Жодна держава не застрахована від ризиків, пов'язаних з нестабільністю фінансової системи. Але особливо уразливими по відношенню до таких ризиків є перехідні економіки, економіки, які розвиваються, оскільки їх ринки стають відкритими, але при цьому зберігаються фундаментальні чинники виникнення фінансової нестійкості. Враховуючи значну нестабільність економічного розвитку в Україні, прискорені зміни структури її соціально-економічного середовища та значну відкритість економіки, країна постійно відчуває на собі дію зовнішніх та внутрішніх шоків, які викликають економічні втрати, заважають країні встати на шлях стійкого і сталого довгострокового економічного зростання та створюють загрозу виникнення економічної кризи. Фінансова система є самим чутливим та вразливим елементом соціально-економічної системи будь-якої країни. Тому побудова системи аналізу стійкості фінансової системи та її інтеграція в систему загальнодержавного управління є надзвичайно важливим та актуальним завданням для України.

Мета такої системи – дослідження економічних процесів, завчасна діагностика ризиків та вироблення системи заходів попере-

дження їх негативних наслідків. Індикатори фінансової стійкості розраховуються з метою проведення макропруденційного аналізу – оцінки та нагляду за міцністю та вразливістю фінансової системи, для посилення її фінансової стійкості та, зокрема, обмеження імовірності виникнення криз у фінансовій системі

У даній роботі ми провели порівняльний аналіз індикаторів валютної кризи, яка відбулася восени 2008 року на тлі поточної глобальної фінансової кризи. Оцінювались прогностичні можливості різних груп індикаторів:

- побудованих за методикою фундаментального аналізу (приріст ВВП, індекс споживчих цін, сальдо поточного рахунку платіжного балансу, приріст експорту, золотовалютні резерви, міжбанківська процентна ставка, індекс реального ефективного валютного курсу та ін.);

- класичних індикаторів технічного аналізу (показники трендів і волатильності, статистичні характеристики курсової динамки, індикатори схильності до зростання/спадання ринку, елементи фрактального аналізу тощо);

- нових еконофізичних індикаторів-передвісників валютних криз (рекурентні діаграми і їх кількісний аналіз, ентропійні індикатори, динаміка спектру мультифрактальності, аналіз фазових перетворень у передкризовий період, теорія випадкових матриць і т.і.).

Показано, що традиційні індикатори, побудовані за методиками як фундаментального так і технічного аналізу, виявляються неспроможними попереджувати наближення кризи. В той же час еконофізичні індикатори можуть бути використані для побудови системи раннього сповіщення кризових явищ.

Обговорюються особливості використання індикаторів для прогнозування кризових явищ в інших сегментах фінансового ринку (фондовому, ринку житла тощо).

НАУКОВЕ ВИДАННЯ

ПРОБЛЕМИ ЕКОНОМІЧНОЇ КІБЕРНЕТИКИ

**XIV Всеукраїнська науково-методична
конференція
8-9 жовтня 2009 р.**

ТЕЗИ ДОПОВІДЕЙ

Підписано до друку 18.09.2009. Формат 60x84.1/16.

Папір офсетний. Друк ризографічний.

Ум. друк. арк. 13,6 Обл.-вид. арк. 15,8

Тираж 300 прим. Ціна договірна.

61077, м. Харків, пл. Свободи, 4,
Харківський національний університет імені В.Н. Каразіна,
Видавництво ХНУ імені В.Н. Каразіна

Надруковано ХНУ імені В.Н. Каразіна

61077, Харків, пл. Свободи, 4.

Тел.: 705-24-32

Свідоцтво про державну реєстрацію ДК № 3367 від 13.01.09