

Міністерство освіти і науки України
Національний технічний університет
«Дніпровська політехніка»

Факультет інформаційних технологій
(факультет)

Кафедра системного аналізу і управління
(повна назва)

ПОЯСНЮВАЛЬНА ЗАПИСКА

кваліфікаційної роботи ступеню ОКР Бакалавра

(бакалавра, магістра)

студента Шишкова Олега Станіславовича

академічної групи 124 – 17 – 1

спеціалізації Системний аналіз

за освітньо-професійною програмою Системний аналіз

на тему: «Розв'язання задач прогнозування та прийняття рішень у діяльності

ПрАТ «ФБ «Перспектива»»

Керівники	Прізвище, ініціали	Оцінка за шкалою		Підпис
		рейтинговою	Інституційною	
Кваліфікаційної роботи	<i>К.т.н., доц. Малієнко А. В.</i>			
розділів:	<i>К.т.н., доц. Малієнко А. В.</i>			
Інформаційно- аналітичний	<i>К.т.н., доц. Малієнко А. В.</i>			
Спеціальний	<i>К.т.н., доц. Малієнко А. В.</i>			
Рецензент	<i>Д.е.н., проф. Усатенко О.В.</i>			
Нормоконтроль	<i>К.ф-м.н., доц. Хом'як Т. В.</i>			

Дніпро
2021

ЗАТВЕРДЖЕНО:
завідувач кафедри
Системного аналізу і управління
(повна назва)

_____ к.т.н., доц. Желдак Т.А.
(підпис) (прізвище, ініціали)

«___» _____ 2021 року
(дата)

ЗАВДАННЯ
на кваліфікаційну роботу

ступеня бакалавра

(освітньо-кваліфікаційний рівень)

студенту Шишкову О.С. академічної групи 124 – 17 – 1

спеціальності: 124 Системний аналіз

спеціалізації: Системний аналіз

за освітньо-професійною програмою: Системний аналіз

на тему «Розв'язання задач прогнозування та прийняття рішень у діяльності

ПрАТ «ФБ «Перспектива»

затверджену наказом ректора НТУ «Дніпровська політехніка»

від “ 07.06.2021 ” № 317-с

Розділ	Зміст	Терміни виконання
<i>1. Інформаційно-аналітичний розділ</i>	Надати характеристику діяльності ПрАТ «ФБ «Перспектива». Проаналізувати фінансово-економічні показники ФБ «Перспектива».	
<i>2. Спеціальний розділ</i>	Дослідити методи прогнозування та прийняття рішень у діяльності фондової біржі. Обрати найбільш надійного контрагента для допуску до торгів. Спрогнозувати облікову ставку НБУ. Запропонувати інструментарій обмеження маніпулювання на фондовому ринку. Розрахувати економічний ефект.	

Завдання видано _____ Малієнко А.В.

Дата видачі: 01.09.2020 р.

Дата подання до екзаменаційної комісії: _____ р.

Прийнято до виконання _____ Шишков О.С.

РЕФЕРАТ

Пояснювальна записка: 76 с., 19 рис., 27 табл., 5 додатків, 52 джерела.

Фондова біржа надає комплекс послуг для професійних учасників ринку капіталів: організація торгів, диверсифіковані розрахунки, електронний документообіг, ІТ-супровід для учасників фондового ринку.

Об'єкт дослідження: біржовий організований ринок фінансових інструментів.

Предмет дослідження: обґрунтування прийняття рішень та прогнозування діяльності професійних учасників на фондовій біржі.

Мета дослідження: розробка аналітичного забезпечення прийняття рішень щодо найбільш прийняттого банку для допуску до торгів на ринку РЕПО та прогнозування базових показників діяльності ринку капіталу.

Методи дослідження та апаратура: метод аналізу ієрархій (для вибору найкращого за п'ятьма критеріями банку до торгів на ринку РЕПО), метод найменших квадратів (для прогнозування впливу інфляції на ставку НБУ), фінансовий аналіз (для оцінки ефективності діяльності ФБ «Перспектива»), метод карт Кохонена (для виявлення маніпулювань на фондовому ринку).

Економічна ефективність: очікується позитивною завдяки здійсненій оцінці поточного стану діяльності фондової біржі відповідно до існуючих тенденцій розвитку фондового ринку України та розробки рекомендацій щодо диверсифікації аналітичного інструментарію для інституціональних інвесторів.

В інформаційно-аналітичному розділі розглянуто технологію біржової торгівлі в Україні, окреслено технологічну модель укладення і виконання біржової угоди, узагальнено проблеми поточного та перспективного розвитку локального фондового ринку.

У спеціальному розділі виконано оцінку найбільш прийняттого банку для допуску до торгів на ринку РЕПО, спрогнозовано ставку НБУ, оцінено ризики зловживань та особливості підозрілих операцій на ринку капіталів.

Практична цінність роботи полягає в можливості підвищення ефективності діяльності фондової біржі за рахунок більш об'єктивної оцінки поточної діяльності та раціонального обґрунтування прийняття рішень на перспективу.

Ключові слова: БІРЖА, ЕФЕКТИВНІСТЬ, ОПТИМІЗАЦІЯ, ОВДП, ПРИБУТОК, ПРОГНОЗУВАННЯ, РЕПО, РИЗИК, РИНОК, ЦІННІ ПАПЕРИ.