

Оценка влияния параметров биржевого рынка акций на динамику индекса Украинской биржи

*И.М. Ройко, аспирант кафедры финансовых рынков,
Киевский национальный экономический университет
имени Вадима Гетьмана
iroyko@meta.ua*

Методология исследования. На основе системного подхода и использования программы статистического анализа MS Excel «Анализ данных» проведено исследование влияния параметров биржевого рынка акций на динамику индекса Украинской биржи. Построена математическая модель влияния параметров биржевого рынка акций на динамику индекса Украинской биржи.

Результаты. Проведенное исследование подтвердило возможность анализа динамики индекса биржевого рынка акций именно на базе исследования рыночных, внутренних факторов, кроме обычных методов анализа: фундаментального или технического. В тоже время необходимы дальнейшие исследования влияний на биржевые индексы акций и таких внутренних факторов, как средний размер сделки на недельных, месячных и годовых интервалах, объем среднесуточных торгов на рынке.

Новизна. За результатами проведенного корреляционно-регрессионного анализа, доказано, что рыночный параметр «Сумма средств, предварительно зарезервированных в Расчетном центре для обеспечения исполнения договоров по ценным бумагам, заключенных на Украинской бирже», имеет значительное влияние на динамику индекса Украинской биржи.

Практическая значимость. Представленная методика исследования влияния внутренних параметров рынка на динамику индекса Украинской биржи может быть использована для моделирования и прогнозирования биржевого рынка акций Украины.