

УДК 336.02

ИССЛЕДОВАНИЕ ФОНДОВОГО РЫНКА С ПОМОЩЬЮ ИНФОРМАЦИОННЫХ ТЕХНОЛОГИЙ

Т. В. БАЖЕНОВ

Научный руководитель С. Н. ГНАТЮК, канд. экон. наук, доц.
БЕЛОРУССКО-РОССИЙСКИЙ УНИВЕРСИТЕТ

В современных условиях эффективная работа на организованном рынке ценных бумаг предполагает применение наукоемких технологий анализа и прогноза количественных характеристик фондовых инструментов, использование прикладного программного обеспечения арсенала математических и информационно-аналитических технологий, ориентированных на формирование и эффективное управление инвестиционным портфелем. При повышающемся уровне организации рынка и жесткой конкурентной борьбе банков, инвестиционных фондов и компаний за клиента – разработка и использование адекватных стратегий управления капиталом стали актуальной задачей.

Развитие теории вероятностей, математической статистики, формирование стохастического исчисления наряду с появлением и совершенствованием вычислительных средств и методов позволило во второй половине XX века рассматривать новые классы задач, связанных с моделированием финансово-экономических процессов. К настоящему времени сформировался целый блок научных дисциплин, относящихся к финансовой проблематике и изучающих экономические, математические, информационно-аналитические и иные теоретические и прикладные аспекты данного круга вопросов.

В работе выделяются два направления исследований, ориентированных на непосредственное использование в практике финансового дилинга. Первое направление относится к разработке активных стратегий и инструментальных средств управления вложениями в отдельные фондовые активы. Второе направление относится к теории портфельных инвестиций, где цель исследования состоит в анализе совокупного эффекта от вложений в различные активы с учетом их взаимовлияния. В настоящей работе делается попытка в определенном смысле объединить два описанных выше подхода. А именно, вводится понятие синтезированного финансового инструмента, представляющего собой совокупность фондового актива и активной стратегии его использования.

Разработан проект экономического направления по работе с различными инструментами на биржах всех стран, цель которого обеспечить качественную реализацию идей крупных игроков на фондовых рынках.