

СЕКЦІЯ 24. ІНФОРМАЦІЙНІ ТЕХНОЛОГІЇ ТА МАТЕМАТИЧНІ МЕТОДИ (м. Ялта)

Майорова А.М., Мицай Ю.М., Україна, Ялта

КОМП'ЮТЕРНЕ МОДЕЛЮВАННЯ ВАЛЮТНОГО РИНКУ

У доповіді проведено комп'ютерне моделювання валютного ринку. Основна увага приділяється перехідним процесом із одного рівноважного стану в інший. Нами запропонована нерівноважна модель ціноутворення з декількома видами спекулятивних стратегій. У пропонованій моделі є три типи учасників ринку: фірми (експортери і імпортери), спекулянти і маркет мейкери. Комп'ютерне моделювання моделі дозволило визначити значення основних параметрів моделі з порівняння з наявними емпіричними даними.

Майорова А.Н., Мицай Ю.Н., Україна, Ялта

КОМПЬЮТЕРНОЕ МОДЕЛИРОВАНИЕ ВАЛЮТНОГО РЫНКА

В докладе проведено компьютерное моделирование валютного рынка. Основное внимание уделяется переходным процессом из одного равновесного состояния в другое. Нами предложена неравновесная модель ценообразования с несколькими видами спекулятивных стратегий. В предлагаемой модели имеется три типа участников рынка: фирмы (экспортеры и импортеры), спекулянты и маркет мейкеры. Компьютерное моделирование модели позволило определить значения основных параметров модели из сравнения с имеющимися эмпирическими данными.

Mayorova A.N., Micyay U.N., Ukraine, Yalta

COMPUTER DESIGN OF CURRENCY MARKET

The computer design of currency market is conducted in and lecture. Basic attention is spared and transient from one equilibrium of state in other. We are offer the non-equilibrium model of pricing with and few kinds of speculative strategies. There are three types of market participants in the offered model: firms (exporters and importers), speculators and market of maiker. The computer design of model allowed defining the values of basic parameters of model from comparing to present empiric information.