

РОЗРОБКА МОДЕЛІ УПРАВЛІННЯ ВАЛЮТНИМИ РИЗИКАМИ НА ПІДПРИЄМСТВІ – СУБ'ЄКТИ ЗЕД

Неговська О.А., Чекмасова І.А.

Національний технічний університет

«Харківський політехнічний інститут», м. Харків

В умовах загострення конкурентної боротьби на світових фінансових та валютних ринках ефективне управління валютними ризиками має пріоритетне значення для вітчизняних підприємств-суб'єктів зовнішньоекономічної діяльності.

Мета роботи – розробка автоматизованої універсальної моделі управління валютними ризиками в умовах невизначеності.

Дослідженню валютних ризиків присвячені наукові праці таких вчених як О.Береславська, Г.Вербицька, В.Вітлінський, Л.Болатова, Р.Кветний, С. Козловський, О.Гуляєва, І.Цветков, А.Семенов, та інші.

Кількісну оцінку ризику пропонується здійснювати на основі теорії нечіткої логіки. Використання теорії нечіткої логіки дає можливість оперувати вхідними даними, заданими нечітко; здійснювати нечітку формалізацію критеріїв оцінки чинників; проводити якісне оцінювання як вхідних даних, так і вихідних результатів; здійснювати моделювання складних економічних систем з заданим рівнем достовірності. Врахування в моделі якісних факторів за допомогою теорії нечіткої логіки дозволяє підвищити точність прогнозування валютних курсів та знизити імовірність грошових втрат суб'єктів валютного ринку.

Запропонована модель базується на комплексному підході і об'єднує всі етапи процесу управління. Універсалізація моделі стосовно різних валют припускає використання індексів відповідних країн. Впровадження та автоматизація моделі виконано в системі імітаційного моделювання MATLAB. Практичне застосування автоматизованої моделі дозволить підприємству мати надійну інформацію щодо співвідношення курсів валют; здійснювати об'єктивну кількісну та якісну оцінку валютних ризиків при проведенні зовнішньоторговельних операцій; систематизувати процес прийняття науковообґрунтованих управлінських рішень щодо здійсненні валютних операцій, керуючись їхньою ефективністю; розробити систему управління ризиками з метою мінімізації втрат при проведенні зовнішньоекономічних операцій з урахуванням фінансової стабільності й можливостей підприємства. Впровадження моделі сприяє підвищенню ефективності управління підприємством і оптимізації руху грошових потоків через зниження залежності фінансових результатів від коливань валютних курсів.