

АНАЛИТИЧЕСКАЯ СИСТЕМА ПО СБОРУ И АНАЛИЗУ ДАННЫХ ФОНДОВЫХ БИРЖ

Жилинский К.С.

*Белорусский государственный университет информатики и радиоэлектроники
г. Минск, Республика Беларусь*

Космыкова Т.С. – ст. преп.

В современной рыночной экономике фондовый рынок играет важнейшую роль. Это подтверждается объективным фактом: в ценных бумагах воплощена большая часть финансовых активов общества. Совокупная величина задолженности по ценным бумагам и капитализации акций более чем в два раза превышает размер мирового ВВП и в три раза величину денежного агрегата M2 (наличные деньги, средства на текущих и срочных счетах банков). Рынок ценных бумаг служит эффективным инвестиционным механизмом, благодаря которому государства и компании привлекают средства для своего развития и реализации социально важных программ.

Предсказуемость поведения фондового рынка интересует как мелкого игрока, вложившего малую сумму в несколько ценных бумаг различных эмитентов, так и крупного институционального инвестора, оперирующего портфелем стоимостью в сотни миллионов долларов. Под предсказуемостью понимается возможность: заранее определять развитие событий и предпринять конкретные действия в рамках, действующих на данный момент правил игры (законодательных актов, ФКЦБ и т.д.) с целью минимизировать потери инвестора и максимизировать прибыль.

Также немаловажным аспектом поведения инвесторов на фондовом рынке являются аномалии различного рода: связанные с ценами и доходностями, объемом торгов и волатильностью, календарные аномалии и прочие. В каждой группе существование аномалий объясняется похожими причинами, и все они тесно связаны между собой, могут проявляться раздельно или совместно с возможной высокой зависимостью. Следует отметить, что влияние таких аномалий на фондовый рынок, поведение компаний и инвесторов растет из года в год, так как за счет их включения в торговые стратегии появляется возможность генерирования большой сверхприбыли.

Таким образом, глобализация фондового рынка, обширный интерес инвесторов различного уровня к проблемам аномалий свидетельствуют о наличии значительного потенциала в сфере их исследования. Аналитики, экономисты, инвесторы и сами компании заинтересованы в удобной платформе, которая сможет помочь контролировать данные с бирж, проверять их работу, находить ошибки, business insights (верное, но нестандартное поведение акций полезное для бизнеса), составлять корректные исторические данные, вести статистику, а также находить интересные закономерности не только в рамках данных биржи, но и совокупно с другими показателями компании, такими как локации офисов компании, ключевые люди, финансовые отчеты компании, количество сотрудников, количество открытых вакансий и так далее. Данный проект есть попытка создания такой платформы.

В ходе научного исследования было создано программное средство, предназначенное для помощи финансовым аналитикам активно следить за данными, поступающими с бирж, анализировать их, находить аномалии, ошибки, и составлять чистые исторические данные, которые в будущем могут быть применены для прогнозирования поведения акций компании на рынке.

Список использованных источников:

1. Информационная система [Электронный ресурс]. – Режим доступа: <https://its.1c.ru/>