

МОДЕЛИРОВАНИЕ ОБМЕННОГО КУРСА ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К УКРАИНСКОЙ ГРИВНЕ

Иващенко Е. А.

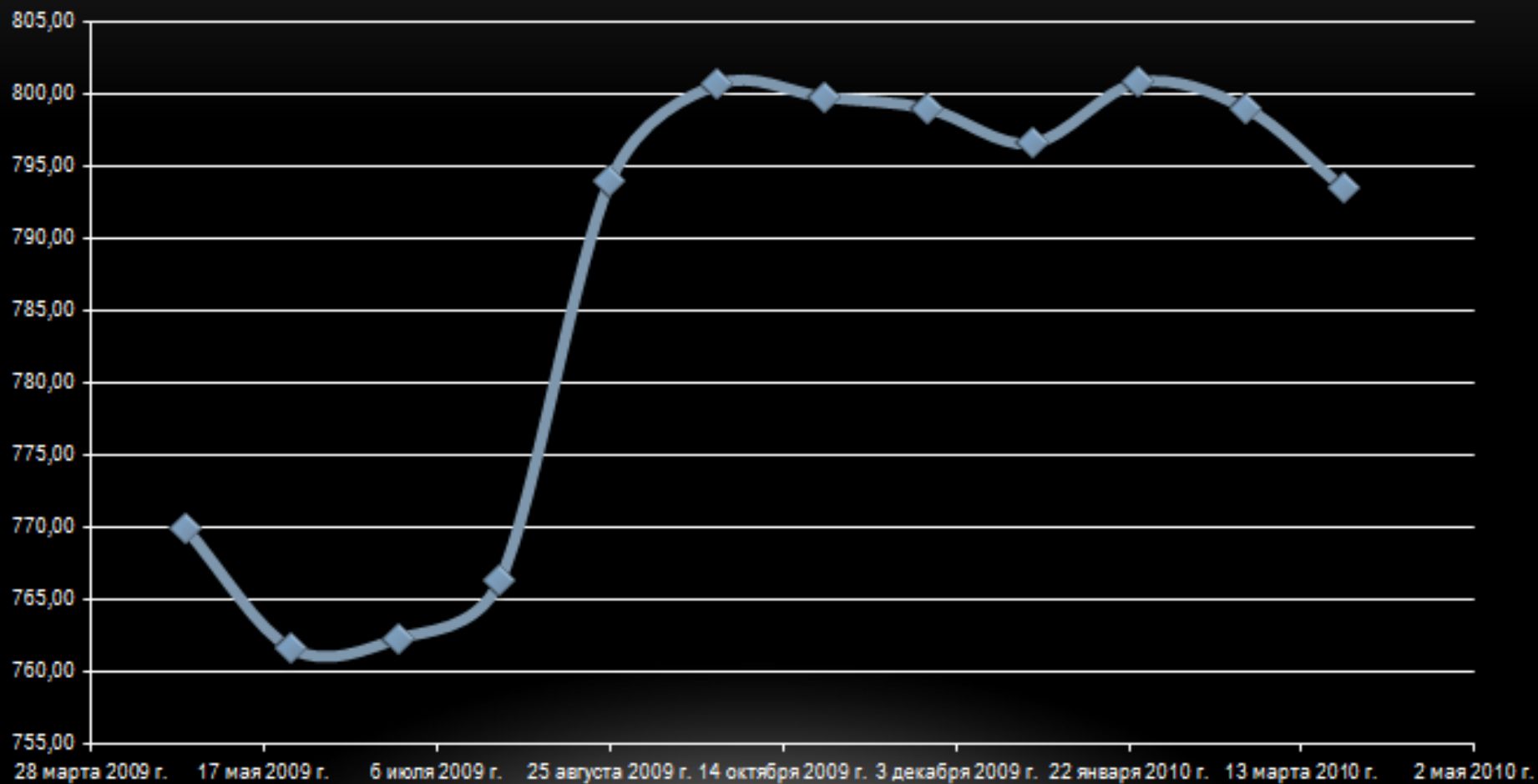
Научный руководитель: Шкуренко О.В., ст. преподаватель

Донецкий государственный университет управления

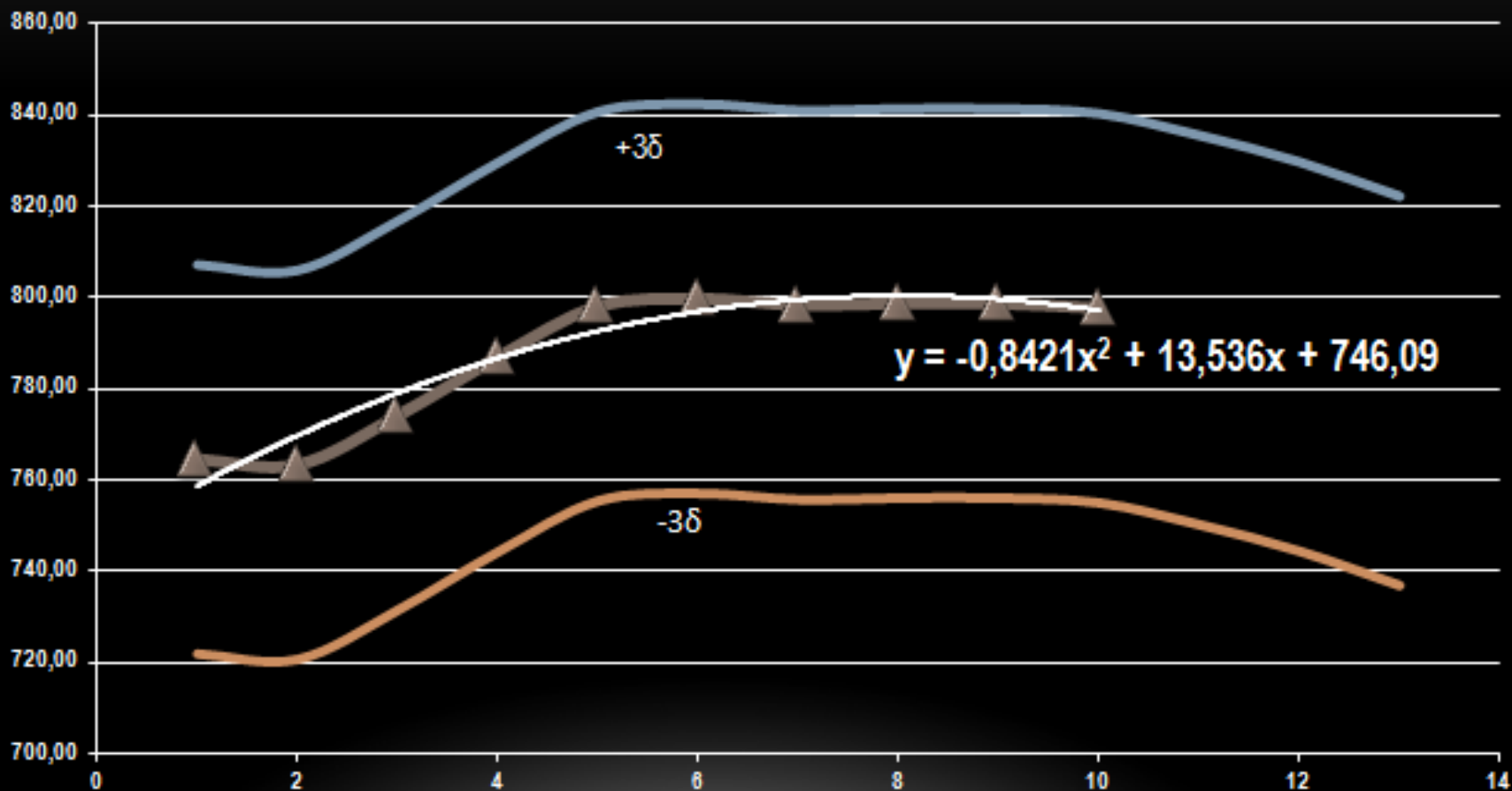
ОБМЕННЫЙ КУРС ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К ГРИВНЕ УКРАИНЫ

24 апреля 2009 г.	770,00
25 мая 2009 г.	761,60
25 июня 2009 г.	762,35
24 июля 2009 г.	766,30
25 августа 2009 г.	794,00
25 сентября 2009 г.	800,68
26 октября 2009 г.	799,80
25 ноября 2009 г.	799,00
25 декабря 2009 г.	796,60
25 января 2010 г.	800,84
25 февраля 2010 г.	799,00
25 марта 2010 г.	793,50

ОБМЕННЫЙ КУРС ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К ГРИВНЕ УКРАИНЫ



ТЕНДЕНЦИЯ ОБМЕННОГО КУРСА ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К ГРИВНЕ УКРАИНЫ



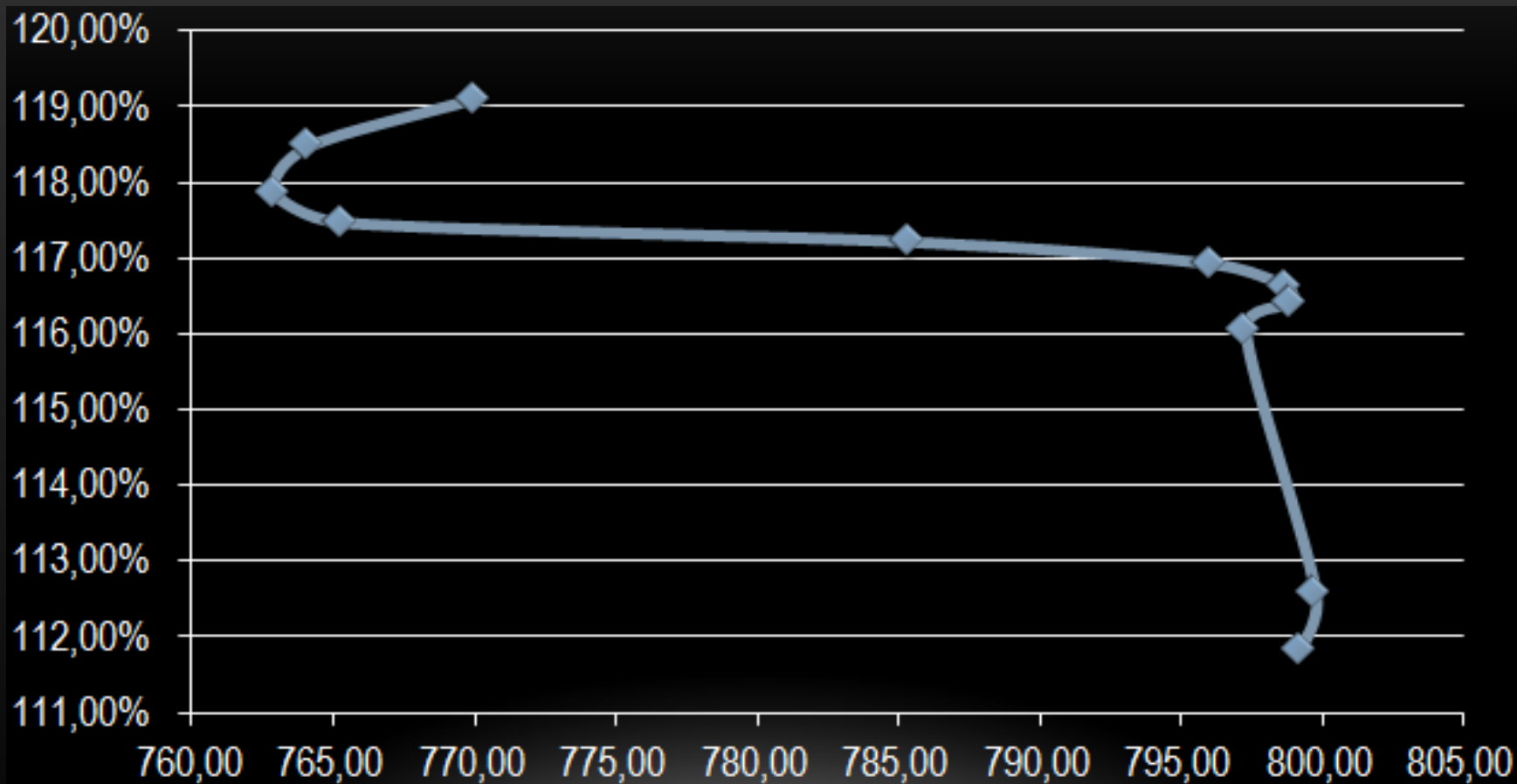
ТЕНДЕНЦИЯ ОБМЕННОГО КУРСА ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К ГРИВНЕ УКРАИНЫ

Уравнение тренда временного ряда	$Y_t = -0,8421 * t^2 + 13,536 * t + 746,09$
Коэффициент корреляции	$r = 0,9643$
Коэффициент детерминации	$r^2 = 0,9298$
Коэффициент аппроксимации	$\bar{A} = 0,38\%$
$F_{\text{факт}} = 14,25 > F_{\text{табл}}$	$t_{\text{факт}} = 3,775 > t_{\text{табл}}$

ПРОГНОЗИРУЕМЫЙ КУРС ДОЛЛАРА США ПО ОТНОШЕНИЮ К ГРИВНЕ УКРАИНЫ

Временной период	Валютный курс
Апрель 2010 г.	793,09
Май 2010 г.	787,26
Июнь 2010 г.	779,74

ЗАВИСИМОСТЬ МЕЖДУ ОБМЕННЫМ КУРСОМ И ИНФЛЯЦИЕЙ



ЗАВИСИМОСТЬ МЕЖДУ ОБМЕННЫМ КУРСОМ И ИНФЛЯЦИЕЙ

Линейное уравнение регрессии	$y = 1,926 - 0,00097 * x$
Коэффициент корреляции	$r = 0,7$
Коэффициент детерминации	$r^2 = 0,48$
Коэффициент аппроксимации	$\bar{A} = 1,14\%$
Коэффициент эластичности	$E_{y/x} = -0,65$

- Долларизация валютных курсов в Украине существенно влияет на характеристики денежной системы. Количественный анализ обменного курса свидетельствует о неэффективной ревальвации гривны как фактора сдерживания инфляции. При сохранении паритетной способности должна наблюдаться девальвация гривны.

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!

19-21 мая 2010 г., г. Черкассы, ЧНУ им. Б. Хмельницкого