

Рассматриваются принципы организации программного обеспечения (ПО) ЭВМ, управляющей стохастической аппаратурой, особенности реализации в ПО математических моделей сигналов и систем и управления испытаниями в реальном масштабе времени.

Литература

1. АС СССР N 1234835. *Управляемый генератор потоков случайных событий*. /Баканович Э.А., Волковец А.И., БИ N 1986 г.
2. АС СССР N 1566347. *Генератор случайных чисел*. /Баканович Э.А., Волковец А.И., БИ N 20, 1986 г.

МАТЕМАТИКО-СТАТИСТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ ОЦЕНКИ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ЭФФЕКТИВНОСТИ ПРОИЗВОДСТВА ПРЕДПРИЯТИЙ ЛЕГКОЙ ПРОМЫШЛЕННОСТИ

И.Н.Аверина

Экономический факультет, БрПИ, г.Брест, Республика Беларусь

К числу ключевых проблем совершенствования деятельности предприятий легкой промышленности относится обобщение результатов экономического анализа их деятельности, оценка эффективности их производства, вскрытие резервов и рациональное их использование. В экономическом анализе имеют широкое распространение методы математической статистики, они используются и в оценке экономической эффективности предприятий, поскольку изменение анализируемых показателей можно представить как случайный процесс, а также играют важную роль в прогнозировании поведения экономических показателей.

В экономических исследованиях эффективности производства нашли применение следующие математико-статистические методы стохастического моделирования хозяйственных явлений и процессов: оценка связи и корреляции между показателями; оценка статистической значимости связей; регрессионный анализ; дисперсионный анализ; современный факторный (компонентный) анализ трансформационный анализ. Необходимость включения математико-статистических методов в методику оценки эффективности производства

предприятий диктуется значимостью решаемых при помощи данных методов статистических задач.

Литература

1. Экономико-математические методы в анализе хозяйственной деятельности предприятий и объединений. - М.: Финансы и статистика, 1982.

ИНДИКАТОР СРОЧНОГО РЫНКА НА ГКО

Н. Л. Богачек, В. А. Зорин
ВМК, ННГУ, Нижний Новгород, Россия

Индикатор ИСР разработан для использования на срочном рынке ГКО. ИСР использует следующие базовые понятия: арбитражное направление, синтетическая облигация (СО), синтетический спред.

Покупкой синтетической облигации будем называть совокупность следующих двух операций: покупка облигации на спотовом рынке (операция 1) и одновременное заключение контракта на продажу этой же облигации на срочном рынке (операция 2). Таким образом доходность до погашения синтетической облигации равна доходности этих двух операций, а срок до погашения равен сроку до исполнения соответствующего фьючерсного контракта.

Если доходность синтетической облигации превышает доходность ГКО то инвестор заключающий контракт на продажу (операция 2) открывает позицию в арбитражном направлении, а инвестор заключающий контракт на покупку открывает позицию в направлении противоположном арбитражному. Если доходность СО меньше доходности ГКО то открытием позиции в арбитражном направлении называем заключение контракта на покупку ГКО.

Пусть доходность ГКО со сроком погашения 30 дней (Y_{30}) равна 20 % годовых, а доходность СО с аналогичным сроком (Y_{s30}) равна 30% годовых. Назовём разность $S_{30} = Y_{s30} - Y_{30}$ синтетическим тридцатидневным спредом. В нашем примере $S_{30} = 10\%$