

MOLIYAVIY BOZORLARDA STATISTIK TAHLIL

Akbarova Barno Shuxratovna

Toshkent davlat iqtisodiyot universiteti

Iqtisodiy statistika kafedrası dotsenti

Yuldashev Yaxyobek Shukurbek o'g'li

Toshkent davlat iqtisodiyot universiteti talabasi

Annotatsiya Mazkur maqolada moliyaviy bozorlarda statistik tahlilning ahamiyati va uning turlari, usullari haqida batafsil ma'lumot beriladi. Shuningdek, statistik tahlil orqali bozor dinamikasini o'rganish, investitsion qarorlarni qabul qilish jarayoni ham ko'rib chiqiladi. Statistik metodlarning zamonaviy dasturiy ta'minot bilan qo'llanilishi ham yoritilgan.

Kalit so'zlar: moliyaviy bozor, statistik tahlil, regressiya, texnik tahlil, fundamental tahlil, investitsiya, risk.

Abstract: This article provides detailed information on the importance of statistical analysis in financial markets and its types and methods. The process of studying market dynamics and making investment decisions through statistical analysis is also considered. The application of statistical methods with modern software is also highlighted.

Keywords: financial market, statistical analysis, regression, technical analysis, fundamental analysis, investment, risk.

Kirish Moliyaviy bozorlar zamonaviy iqtisodiy tizimning ajralmas qismi bo'lib, ularning samarali faoliyat yuritishi iqtisodiy o'sishga bevosita ta'sir ko'rsatadi. Ushbu bozorlarning murakkabligi va dinamik o'zgaruvchanligi ularga ta'sir qiluvchi omillarni chuqur tahlil qilishni talab qiladi. Statistik tahlil esa moliyaviy bozorlarni o'rganish va investitsiya strategiyalarini ishlab chiqishda muhim vosita hisoblanadi. Ushbu maqolada moliyaviy bozorlarda qo'llaniladigan statistik tahlil usullari va ularning afzalliklari haqida so'z yuritiladi.

Asosiy qism

Moliyaviy bozorlarda statistik tahlilning ahamiyati Moliyaviy bozorlarda aktivlarning narxlari va ularning harakati ko'plab ichki va tashqi omillar ta'sirida shakllanadi. Ichki omillar qatoriga kompaniyaning moliyaviy holati, daromadlari, dividend siyosati va boshqaruv strategiyasi kiradi. Tashqi omillar esa global iqtisodiy vaziyat, geosiyosiy xatarlar, inflyatsiya va foiz stavkalari kabi jihatlar bilan bog'liq.

Statistik tahlil yordamida ushbu omillarni o'rganish va ularning bozor narxlariga ta'sirini baholash mumkin. Shuningdek, statistik tahlil yordamida investitsiya qarorlarini qabul qilish jarayoni samarali olib boriladi. Masalan, aksiyalarning kelajakdagi narx dinamikasini taxmin qilish yoki bozorning umumiy trendini tushunish uchun statistik ma'lumotlardan

foydalaniladi. Bu esa investorlarning yo'qotish xavfini kamaytirishga va kapitalni samarali boshqarishga yordam beradi.

Statistik tahlil usullari Moliyaviy bozorlarda statistik tahlilning bir necha asosiy usullari mavjud bo'lib, har biri o'ziga xos yondashuvni talab qiladi:

Deskriptiv statistika: Moliyaviy ma'lumotlarni tavsiflash va tartibga solish uchun ishlatiladi. Bu usul orqali aktivlarning o'rtacha qiymati, dispersiyasi, standart og'ishlari va boshqa statistik ko'rsatkichlari hisoblab chiqiladi. Masalan, aksiyalar bozorida ma'lum bir kompaniyaning o'rtacha haftalik savdo hajmini aniqlash deskriptiv statistika vositasida amalga oshiriladi.

Regressiya tahlili: Moliyaviy ko'rsatkichlar o'rtasidagi bog'liqlikni aniqlash va ular orasidagi sabab-oqibat munosabatlarini tushunish uchun ishlatiladi. Bu usul orqali investitsiya natijalari va iqtisodiy omillar o'rtasidagi bog'liqlik tahlil qilinadi. Masalan, regressiya modeli yordamida aksiyalarning narxiga ta'sir qiluvchi asosiy omillar aniqlanib, ularning ta'sir darajasi baholanadi.

Vaxt qatorlari tahlili: Moliyaviy bozor ma'lumotlarini vaqt bo'yicha tahlil qilish va kelajakdagi tendensiyalarni aniqlash imkonini beradi. Ushbu usul yordamida aksiyalar narxining o'zgarishi, foiz stavkalari yoki valyuta kurslarining dinamikasi tahlil qilinadi. Vaxt qatorlari tahlili treyderlar va investorlar tomonidan bozor harakatlarini oldindan taxmin qilishda keng qo'llaniladi.

Ehtimollik taqsimotlari: Risklarni baholash va moliyaviy aktivlarning narx harakatini prognoz qilishda qo'llaniladi. Ushbu usul xavf darajasini aniqlash va investitsiya strategiyalarini moslashtirish uchun ishlatiladi. Masalan, aksiyalar bozori uchun VaR (Value at Risk) usuli orqali yo'qotish ehtimollari baholanadi.

1-jadval

O'zbekiston fond bozorida asosiy ko'rsatkichlar (2023)

Ko'rsatkich	Qiymat
Aksiyalar bo'yicha savdo hajmi (mlrd so'm)	5 600
Obligatsiyalar bo'yicha savdo hajmi (mlrd so'm)	3 200
O'rtacha dividend daromadliligi (%)	12.5
Bozor kapitalizatsiyasi (mlrd so'm)	98 400

Statistik tahlil uchun bugungi kunda turli dasturiy vositalar qo'llaniladi. Masalan, R, Python, MATLAB kabi dasturlar yordamida murakkab statistik tahlillar amalga oshiriladi. Shuningdek, sun'iy intellekt va mashinani o'rganish algoritmlari yordamida bozor prognozlari yanada aniqroq bo'lishi mumkin.

Xulosa

Moliyaviy bozorlarda statistik tahlil qilish investorlarga va treyderlarga aniq qaror qabul qilishda katta yordam beradi. Statistik tahlil vositalari orqali bozor dinamikasini tushunish, risklarni kamaytirish va samarali investitsion strategiyalarni ishlab chiqish imkoniyati

yaratiladi. Shuningdek, zamonaviy texnologiyalar bilan birgalikda qo'llanganda, statistik tahlil yanada kuchli va ishonchli natijalar beradi.

FOYDALANILGAN ADABIYOTLAR:

1. Abduqodirov, A. (2018). Moliyaviy bozorlarda investitsiyalar. Toshkent: Fan.
2. Karimov, U. (2020). Iqtisodiy statistika. Toshkent: O'zbekiston Milliy Ensiklopediyasi.
3. Yuldashev, M. (2019). Kapital bozorlarini tahlil qilish. Toshkent: Iqtisodiyot.
4. O'zbekiston Respublikasi Kapital bozorini rivojlantirish agentligi (2023). Yillik hisobot.
5. Fama, E. F. (1970). Efficient Capital Markets: A Review of Theory and Empirical Work. Journal of Finance.