

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ФАКУЛЬТЕТ ПРИКЛАДНОЙ МАТЕМАТИКИ И ИНФОРМАТИКИ
Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе

**«Исследование байесовского подхода в выборе
оптимального портфеля инвестиций»**

Рымкевич Виктория Сергеевна

Научный руководитель – кандидат физико-математических
наук, доцент В.А. Морозов

2017

РЕФЕРАТ

Дипломная работа, 65 страниц, 17 рисунков, 9 таблиц, 14 источников, 4 приложения.

Ключевые слова: МОДЕЛИ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ, ПРЕДСКАЗАНИЕ ВРЕМЕННЫХ РЯДОВ, БАЙЕСОВСКАЯ РЕГРЕССИЯ, МОДЕЛЬ СКРЫТОГО ИСТОЧНИКА, ФОРМИРОВАНИЕ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ, ПОРТФЕЛЬНАЯ ТЕОРИЯ МАРКОВИЦА, ПОСТРОЕНИЕ ПОРТФЕЛЯ С УЧЕТОМ ОЖИДАНИЙ ИНВЕСТОРА

Объект исследования: портфельное инвестирование.

Предмет исследования: методы построения оптимальных инвестиционных портфелей на основе моделирования и прогнозирования временных рядов.

Цель работы: рассмотрение различных моделей временных рядов, рассмотрение методов построения оптимального портфеля, разработка эффективной торговой стратегии.

Методы исследования: методы математической статистики и теории вероятностей.

Результат: сравнение классических подходов моделирования временных рядов и построения оптимального инвестиционного портфеля, вывод динамической торговой стратегии управления инвестиционным портфелем.

Областью применения является портфельное инвестирование.

ABSTRACT

Graduate work, 65 pages, 17 figures, 9 tables, 14 sources, 4 applications.

Key words: TIME SERIES MODELS, TIME SERIES FORECAST, BAYESIAN REGRESSION, LATENT SOURCE MODEL, FORMATION OF INVESTMENT PORTFOLIO, MARKOWITZ PORTFOLIO THEORY, FORMATION OF PORTFOLIO WITH INVESTOR PRIOR BELIEFS

Object of study: portfolio investment.

Subject of study: methods of optimal investment portfolios construction based on modeling and forecasting time series.

Objective: consideration of different time series models, consideration of methods of optimal investment portfolios construction, development of an effective trading strategy.

Methods of research: methods of mathematical statistics and probability theory.

Result: comparison of classical approaches of modeling time series and constructing optimal investment portfolios, development of a dynamic trading strategy for managing an investment portfolio.

The field of application is the portfolio investment.