

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ЭКОНОМИЧЕСКИЙ ФАКУЛЬТЕТ
Кафедра аналитической экономики и эконометрики

Аннотация
к дипломной работе

ВЫБОР ОПТИМАЛЬНОЙ СТРУКТУРЫ ПОРТФЕЛЯ АКТИВОВ

СЕРГЕЙЧИК АРТЁМ ИГОРЕВИЧ

Научный руководитель:
доктор экономических наук,
профессор Самаль С.А.

Минск, 2017

РЕФЕРАТ

Работа содержит: 60 с., 11 рисунков, 10 таблиц, 13 источников, 2 приложений.

Ключевые слова: ПОРТФЕЛЬ, АКЦИЯ, СТРУКТУРА, МОДЕЛЬ, ИНВЕСТИЦИИ, РИСК.

Цель работы заключается в глубоком исследовании вопроса формирования структуры портфеля активов и на основе данных знаний сформировать портфель активов.

Объектом исследования является инвестиционный портфель.

Методы исследования: общие методы научного познания, такие как методы теоретического исследования.

В процессе работы были получены следующие результаты: были углубленно изучены модели формирования портфеля: модель Гарри Марковица, модель Джеймса Тобина и модель Блэка-Литтермана и на основе данных моделей был сформированы портфели активов.

Новизна полученных результатов заключается в использовании полученных знаний при формировании портфеля активов

Степень внедрения и рекомендации по внедрению полученных результатов: данная работа рекомендуется для более детального разбора моделей формирования портфеля активов: модель Гарри Марковица, модель Джеймса Тобина и модель Блэка-Литтермана.

Автор работы подтверждает, что работа выполнена самостоятельно и приведенный в ней расчетно-аналитический материал правильно и объективно отражает состояние исследуемого процесса, а все заимствованные из литературных и других источников теоретические, методологические положения и концепции сопровождаются ссылками на их авторов.

ANNOTATION

The work contains: 60 pages, 11 illustration, 10 tables, 13 sources, 2 applications.

Keywords: PORTFOLIO, SHARE, STRUCTURE, MODEL, INVESTMENT, RISK.

The purpose of the work is to study the issue of formation of the structure of the asset portfolio and, based on the knowledge data, to form a portfolio of assets.

The object of the research is an investment portfolio

Research methods: general methods of scientific knowledge, such as methods of theoretical research

In the course of the work, the following results were obtained: models of portfolio formation were more deeply studied: the Harry Markowitz model, the James Tobin model and the Black-Litterman model, and based on these models, asset portfolios were formed

The novelty of the obtained results consists in using the acquired knowledge in the formation of the asset portfolio

Degree of implementation and recommendations for the implementation of the results: this work is recommended for a more detailed analysis of models of formation of the portfolio of assets: the Harry Markowitz model, the James Tobin model and the Black-Litterman model

The author of the paper confirms that the work was done independently and the calculation and analytical material presented in it correctly and objectively reflects the state of the process under investigation, and all theoretical, methodological positions and concepts borrowed from literary and other sources are accompanied by references to their authors.