

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

ГОСУДАРСТВЕННОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ ОБРАЗОВАНИЯ
«ИНСТИТУТ БИЗНЕСА БЕЛОРУССКОГО ГОСУДАРСТВЕННОГО
УНИВЕРСИТЕТА»

Кафедра инновационного управления

ТИМОФЕЙЧИК
Роман Федорович

**ПОДХОД МАРКОВИЦА К УПРАВЛЕНИЮ ПОРТФЕЛЕМ
ВАЛЮТНЫХ ВКЛАДОВ**

Магистерская диссертация

специальность 1-26 81 16 Финансовый менеджмент

Научный руководитель
Алексей Владимирович
Кривко-Красько
к.ф.-м.н., доцент

Допущена к защите
«___» _____ 2020г.
Заведующий кафедрой
инновационного управления
_____ Е.А. Поддубская
кандидат педагогических наук

Минск, 2020

ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА РАБОТЫ

Магистерская диссертация, 58 стр, 1 табл., 17 рис., 8 листингов, 10 источников

Ключевые слова: ПОРТФЕЛЬ ВАЛЮТНЫХ ВКЛАДОВ, ПОДХОД МАРКОВИЦА, ЭФФЕКТИВНАЯ ГРАНИЦА, ВИЗУАЛИЗАЦИЯ ДАННЫХ.

Объект исследования: портфели валютных вкладов и метод Марковица, применяемый для управления ими.

Цель работы: исследовать и оптимизировать процесс управления портфелем валютных вкладов.

Методы исследования: методы математической статистики, программирование, визуализация данных.

Результат работы: отчет для визуального анализа инвестиционной деятельности, программируемая система мониторинга управления портфелем валютных вкладов.

Область применения результатов: инвестиционная деятельность.

АГУЛЬНАЯ ХАРАКТЕРЫСТЫКА РАБОТЫ

Магістарская дысертацыя, 58 стар, 1 табл., 17 мал., 8 лістынгаў, 10 крыніцы

Ключавыя словы: ПАРТФЕЛЬ ВАЛЮТНЫХ УКЛАДАЎ, ПАДЫХОД МАРКОВИЦА, ЭФЕКТЫЎНАЯ МЯЖА, ВІЗУАЛІЗАЦЫЯ ДАДЗЕННЫХ.

Аб'ект даследавання: партфелі валютных укладаў і метады Марковица, які ўжываецца для кіравання імі.

Мэта працы: даследаваць і аптымізаваць працэс кіравання партфелем валютных укладаў.

Метады даследавання: метады матэматычнай статыстыкі, праграмаванне, візуалізацыя дадзеных.

Вынік працы: справаздачу для візуальнага аналізу інвестыцыйнай дзейнасці, Праграмуемы сістэма маніторынгу кіравання партфелем валютных укладаў.

Вобласць прымянення вынікаў: інвестыцыйная дзейнасць.

GENERAL DESCRIPTION OF WORK

Master's dissertation, 55 pages, 1 table, 17 figures, 8 listings, 10 sources

Key words: PORTFOLIO OF CURRENCY DEPOSITS, MARKOWITZ THEORY, EFFECTIVE FRONTIER, DATA VISUALIZATION.

Object of study: portfolios of currency deposits and the Markowitz method used to manage them.

Objective: to study and optimize the process of managing the portfolio of foreign currency deposits.

Methods of research: methods of mathematical statistics, programming, data visualization.

Result: a report for visual analysis of investment activity, a programmable system for monitoring the management of the portfolio of foreign currency deposits.

The field of application: investment activity.