

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

Факультет прикладной математики и информатики

Кафедра теории вероятностей и математической статистики

Аннотация к дипломной работе
СТОП-ЛОСС МОДЕЛЬ УПРАВЛЕНИЯ РИСКАМИ

Турбин Максим Вячеславович

Научный руководитель – доцент кафедры ТВиМС ФПМИ,
кандидат физико-математических наук, Меленец Юрий Витальевич

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 52 страницы, 8 рисунков, 4 таблицы, 7 источников, 2 приложения.

Ключевые слова: РИСК, МОДЕЛЬ, ИНВЕСТИЦИИ, СТРАТЕГИЯ СТОП-ЛОСС, УПРАВЛЕНИЕ РИСКОМ.

Объект исследования: стоп-лосс стратегия защиты инвестиций.

Цель исследования: исследование защитной инвестиционной стратегии стоп-лосс.

Методы исследования: методы математической статистики и теории вероятностей, методы математического анализа.

Результат: исследование зависимости результатов применения стоп-лосс стратегии от параметров стратегии и рыночной модели, определение их оптимальных соотношений, проверка критериев эффективности стратегии стоп-лосс.

Область применения: финансовые рынки инвестиционных компаний.

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца: 52 старонкі, 8 малюнкаў, 4 табліцы, 7 крыніцы, 2 прыкладанні.

Ключавыя словы: РЫЗЫКА, МАДЭЛЬ, ІНВЕСТЫЦЫІ, СТРАТЭГІЯ СТОП-ЛОСС, КІРАВАННЕ РЫЗЫКАЙ.

Аб'ект даследавання: стоп-лосс стратэгія аховы інвестыцый.

Мэта даследавання: даследаванне ахоўнай інвестыцыйнай стратэгіі стоп-лосс.

Метады даследавання: метады матэматычнай статыстыкі і тэорыі верагоднасцяў, метады матэматычнага аналізу.

Вынікі: даследаванне залежнасці вынікаў прымянення стоп-лосс стратэгіі ад параметраў стратэгіі і рынкавай мадэлі, вызначэнне іх аптымальных суадносін, праверка крытэрыяў эфектыўнасці стратэгіі стоп-лосс.

Вобласць ўжывання: фінансавыя рынкі інвестыцыйных кампаній.

ABSTRACT

Graduate work: 52 pages, 8 figures, 4 tables, 7 sources, 2 applications.

Keywords: RISK, MODEL, INVESTMENT, STOP-LOSS STRATEGY, RISK MANAGEMENT.

The object of the research: investment protection stop-loss strategy.

The purpose of the research: research on a protective investment stop-loss strategy.

Methods of research: methods of mathematical statistics and probability theory processes, mathematical analysis.

Result: investigation of the dependence of the results of the application of the stop-loss strategy on the parameters of the strategy and market model, determination of their optimal relationships, proving the criteria for the effectiveness of the strategy of stop-loss.

Scope of application: financial markets of investment companies.