

Моделиране на инвестиции във финансови портфейли и числени методи

проф. Иван Иванов

Стопански факултет, СУ „Св. Климент Охридски“

Абстракт. Докладът разглежда модел за оптимално управление на една стохастична система, моделирана чрез стандартно Брауново лутане (Винеров процес). Моделът се прилага за управление на инвестициите в портфейл от различни видове акции, търгувани на даден финансов пазар. За намиране на оптималното управление в модела се налага да се пресметне максималното решение на обобщено непрекъснато Рикатиево уравнение.

Акценти на доклада:

- числени методи за пресмятане на максималното решение на обобщеното Рикатиево уравнение;
- практическа интерпретация на модела: компютърни симулации; трудности при реализацията на модела.