

СИСТЕМА ОПТИМИЗАЦИИ ИНВЕСТИПРОЕКТОВ

Белорусский государственный университет информатики и радиоэлектроники
г. Минск, Республика Беларусь

Ламейко В.И.

Панфиленко А.С. – ассистент, магистр технических наук

Инвестиции являются неотъемлемой составной частью современной экономики. Без широкого применения аналитических систем при осуществлении инвестиционных операций невозможно прибыльное и интенсивное развитие инвестиционного фонда. Использование различных математических моделей позволяют минимизировать риски. Инвестиции долгосрочные вложения капитала с целью получения прибыли или сохранения капитала. От кредитов инвестиции отличаются степенью риска для инвестора — кредит и проценты необходимо возвращать в оговорённые сроки независимо от прибыльности проекта, инвестиции возвращаются и приносят доход только в прибыльных проектах. Если проект убыточен — инвестиции могут быть утрачены полностью или частично. Поэтому важно учесть все риски при инвестировании.

Целью данной работы стала разработка системы оптимизации инвестиционных проектов, позволяющая выполнять следующие задачи: составление инвестиционных портфелей; выполнение оптимизаций с целью уменьшения рисков и увеличения прибыльности; просмотр результата оптимизаций. (Рис.1)

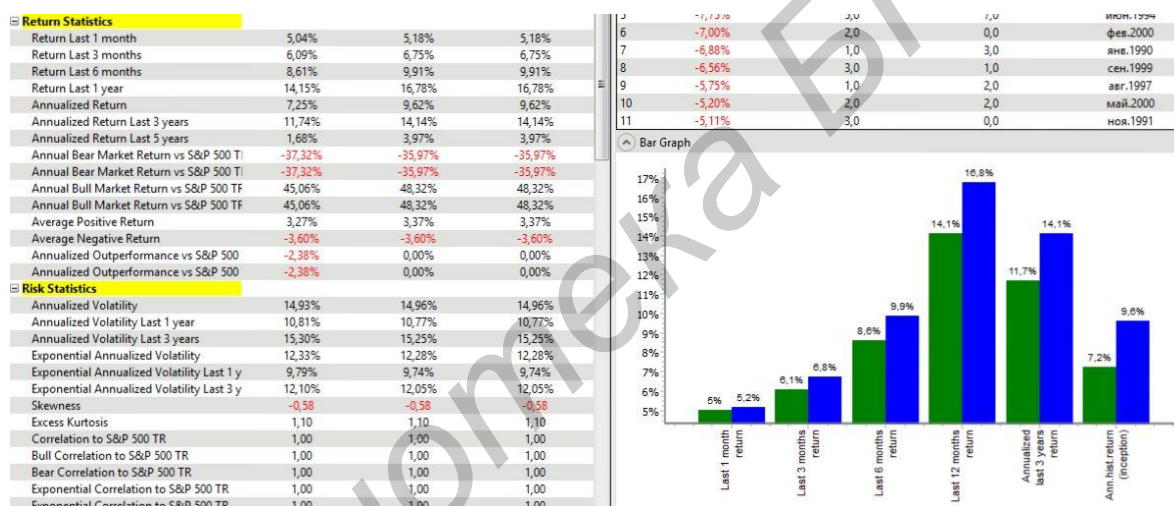


Рис. 1 - Пример отображения результатов оптимизации

Для оптимизации портфеля использовано несколько методов оптимизации, такие как классическая оптимизация по модели Гарри. Марковица, оптимизация модифицированной рискованной суммы, условной рискованной суммы.

Список использованных источников:

1. Уильям Ф. Шарп, Гордон Дж. Александер, Джеффри В. Бейли. Инвестиции. Инфра-М. 2010 – 1028с.
2. Б. А. Райзберг, Л. Ш. Лозовский, Е. Б. Стародубцева. Современный экономический словарь. Инфра-М. 2010 – 512с.