

Іваницький В.Д., Кобилка О. В., Чжан Цюн, Україна, Харків

ОПТИМІЗАЦІЯ ІНВЕСТИЦІЙНОГО ПОРТФЕЛЮ З ДВОХ НЕЗАЛЕЖНИХ АКТИВІВ

У доповіді розглянуто інвестиційний портфель із двох активів з мінімальним ризиком. Активами слугують 4 типи цінних паперів США. Розрахована кореляційна матриця для цих типів, показана некореляційність 1 та 4 типів, які утворюють оптимальний портфель. Отримана формула для знаходження структури оптимального портфелю із двох незалежних активів.

Іваницький В.Д., Кобылка А. В., Чжан Цюн. Украина, Харьков

ОПТИМИЗАЦИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ ИЗ ДВУХ НЕЗАВИСИМЫХ АКТИВОВ

В докладе рассмотрен инвестиционный портфель из двух активов с минимальным риском. Активами служат 4 типа ценных бумаг США, Вычислена корреляционная матрица для этих типов, показана некоррелированность 1 и 4 типов, образующих оптимальный портфель. Получена формула для нахождения структуры оптимального портфеля из двух независимых активов.

Ivanitzky V.D., Kobylka A.V., Chgan Zun, Ukraine, Kharkov

OPTIMIZATION OF INVESTMENT PORTFOLIO CONSIST OF INDEPENDENT SECURITIES

In the report is considered the investment portfolio consist of two assets with minimal risk. The assets are four types of securities of the USA. There are demonstrated the un-correlation of the 1-st and 4-th types that forming the optimal portfolio. Receipted the formula for finding the structure of optimal portfolio consist of independent assets.