Лабораторная работа 7.

Формирование оптимального пакета ценных бумаг инвестиционной фирмы.

Выполнил: Студент ЭМФ31 Какорин А.В.

Проверил: к.т.н., доцент Растеряев Н.В.

**Постановка задачи.** Предположим, что инвестиционная фирма может вложить наличный капитал К в следующем инвестиционном периоде ценные бумаги N видов.

**Требуется** определить соответствующие доли вложений при различной политике формирования инвестиционного портфеля.

**• Модель 1.** Максимизация ожидаемого дохода при ограничении на общий объем инвестиций.



Рисунок 1. Параметры поиска решения задачи 1-ой модели.



Рисунок 2. Результаты поиска решения задачи 1-ой модели.

**• Модель 2.** Максимизация ожидаемого дохода при ограничениях, определяемых политикой фирмы.



Рисунок 3. Параметры поиска решения 2-ой модели: «Осторожной».



Рисунок 4. Результат поиска решения 2-ой модели: «Осторожной».



Рисунок 5. Параметры поиска решения 2-ой модели: «Консервативной».



Рисунок 6. Результат поиска решения 2-ой модели: «Консервативной».



Рисунок 7. Параметры поиска решения 2-ой модели: «Спекулятивной».



Рисунок 8. Результат поиска решения 2-ой модели: «Спекулятивной».



Рисунок 9. Решение 1-ой модели в среде пакета МС.



Рисунок 10. Решение 2-ой модели «Осторожной» в среде пакета МС.



Рисунок 11. Решение 2-ой модели «Консервативной» в среде пакета МС.



Рисунок 12. Решение 2-ой модели «Спекулятивной» в среде пакета МС.