

РЕФЕРАТ

Дипломна робота: 60 с., 23 рис., 45 джерел, 2 додатка.

АНАЛІЗ РИЗИКІВ ФІНАНСОВИХ ПОРТФЕЛЕЙ, БАЄСОВСЬКИЙ СЛЬОЗНИЙ ЛИСТ, ОЦІНКА РИЗИКІВ, УПРАВЛІННЯ РИЗИКАМИ, ФІНАНСОВІ РИЗИКИ.

Актуальність теми: зараз Україна знаходиться в ситуації , коли їй потрібно грамотно інвестувати свої кошти. Проте зараз в підвищених умовах невизначеності складно обрати доцільний об'єкт інвестування. Таким чином виникає необхідність застосування новітніх систем аналізу ризиків фінансових портфелів та торгових стратегій .

Мета даної роботи полягає у дослідженні існуючих методик аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів.

Об'єкт дослідження: методи для аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів.

Предмет дослідження : backtest дані фінансових портфелів, виявлення їх ризиків та ефективності.

Практична значимість дипломної роботи полягає в можливості безпосереднього використання результатів роботи для побудови подальшої торгової стратегії.

Використаний програмний продукт реалізований QuantopianInc. за допомогою мови програмування Python , що добре працює у комбінації з backtesting open source бібліотекою Zipline. Програмний код знаходиться у відкритому доступі.

Отримані результати: проведений огляд деяких відомих методів оцінки та управління ризиками. Проведений аналіз вхідних тестових даних та отриманих результатів.