

# МЕТОДИ ТА ЗАСОБИ АНАЛІЗУ ФІНАНСОВИХ РИЗИКІВ НА ОСНОВІ КОМП'ЮТЕРНИХ СИСТЕМ

Виконав студент 4 курсу групи КК-45  
Чупрін Денис Станіславович

Керівник: професор кафедри ММСА  
Мухін Вадим Євгенович

# ПОСТАНОВКА ЗАДАЧІ

- Виконати огляд існуючих методів оцінки та управління ризиками
- Виконати обчислювальні експерименти за допомогою програмного забезпечення з використанням фактичних тестових даних.
- Проаналізувати отримані результати, визначити перспективи подальших досліджень

# ОБ'ЄКТ ТА ПРЕДМЕТ ДОСЛІДЖЕННЯ

- Об'єкт дослідження : методи для аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів.
- Предмет дослідження : backtest дані фінансових портфелів, виявлення ризиків та ефективності портфелів.
- Мета : дослідження існуючих методик аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів .

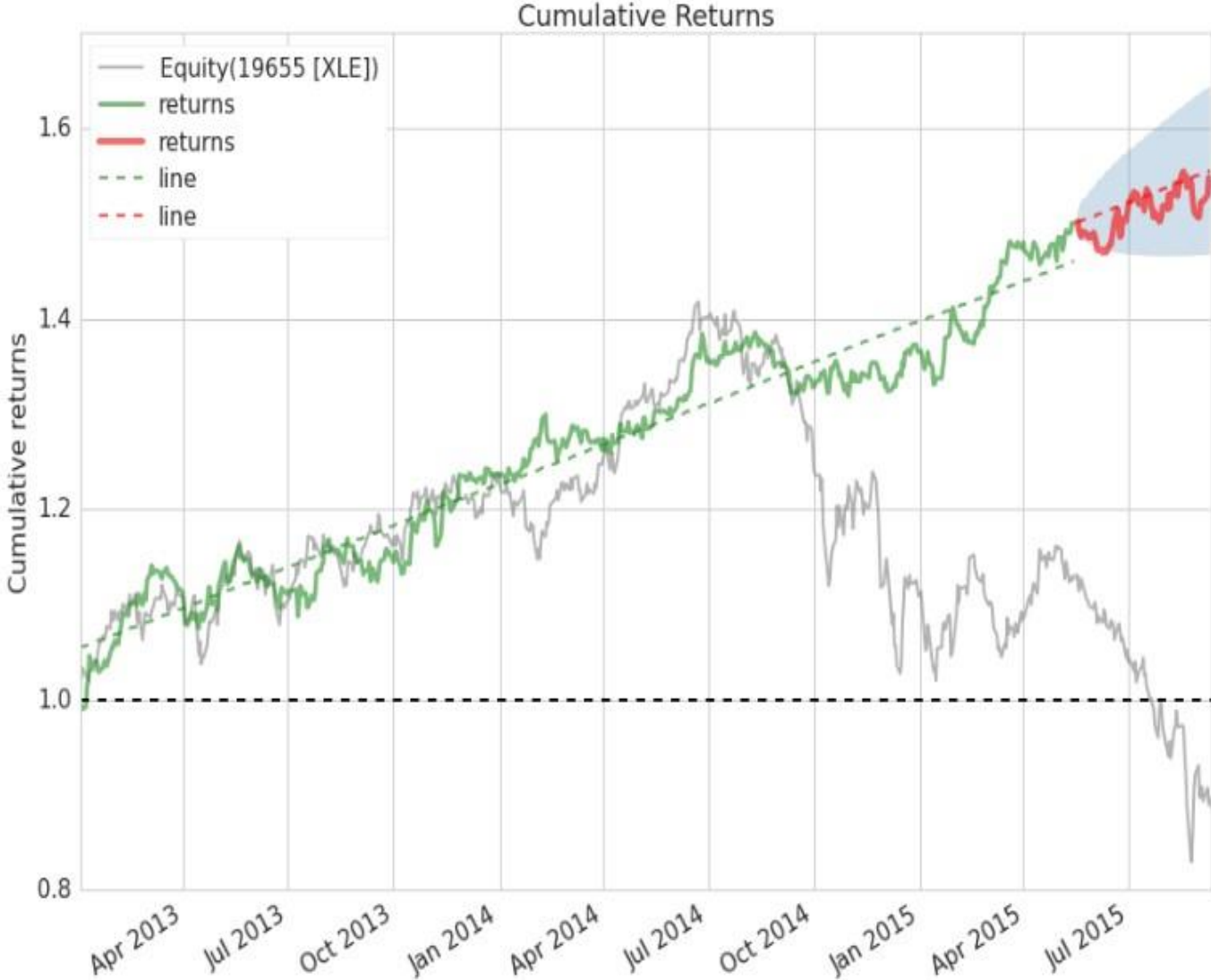
# АКТУАЛЬНІСТЬ

- Аналіз ефективності та ризиків фінансових портфелів завжди був необхідним для успішного ведення торгової стратегії . Особливо зараз, коли економіка знаходиться в нестабільному стані. Тому актуальність теми ще довгий період себе не вичерпає.
- Правильне і точне визначення ключових показників дозволить приймати на їх основі виграшні рішення з більшою вірогідністю.
- Скорочується час обробки інформації і вибудовується більш доступний в плані розуміння для користувача результат

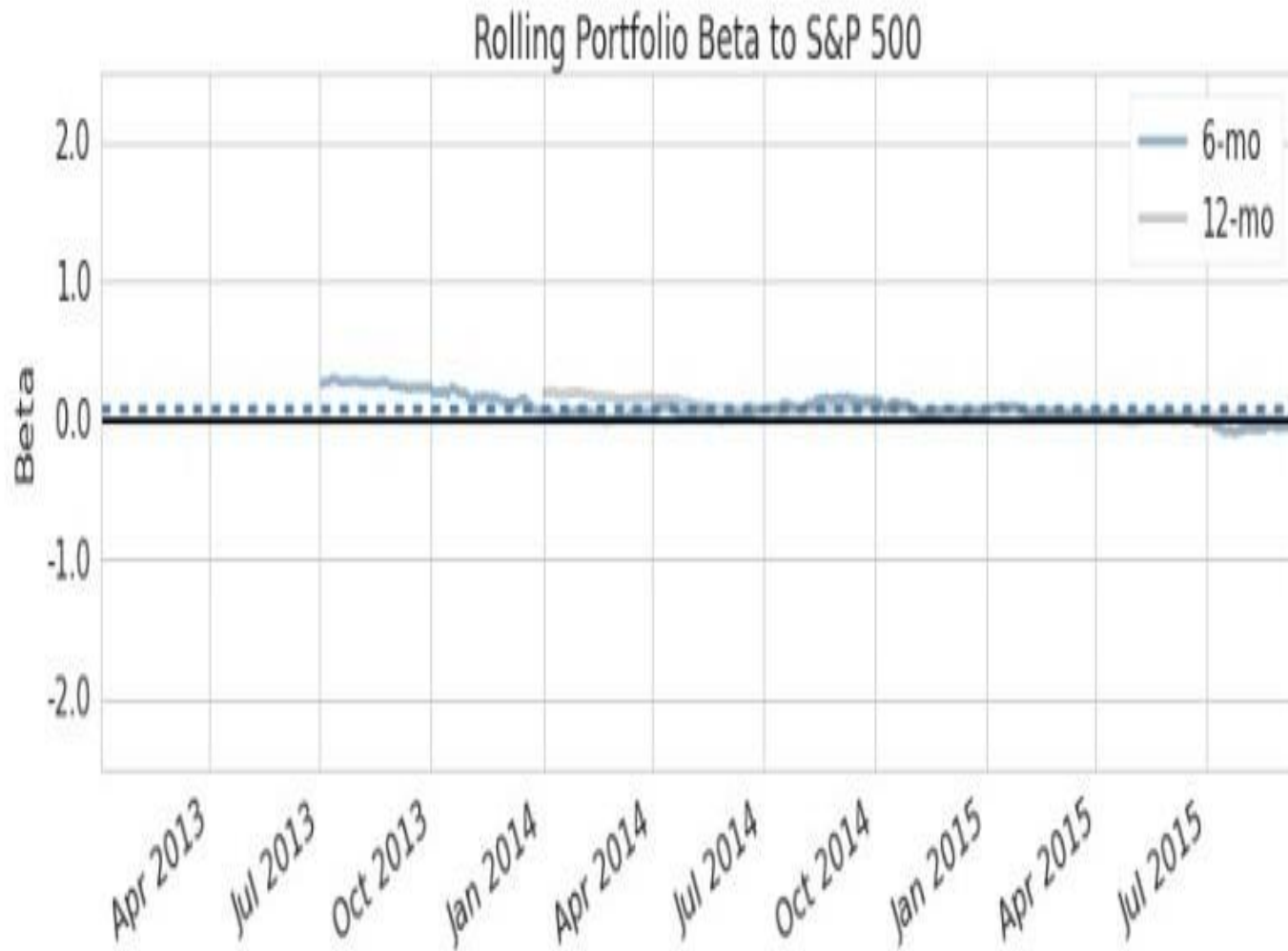
# DRAWDOWN PERIODS



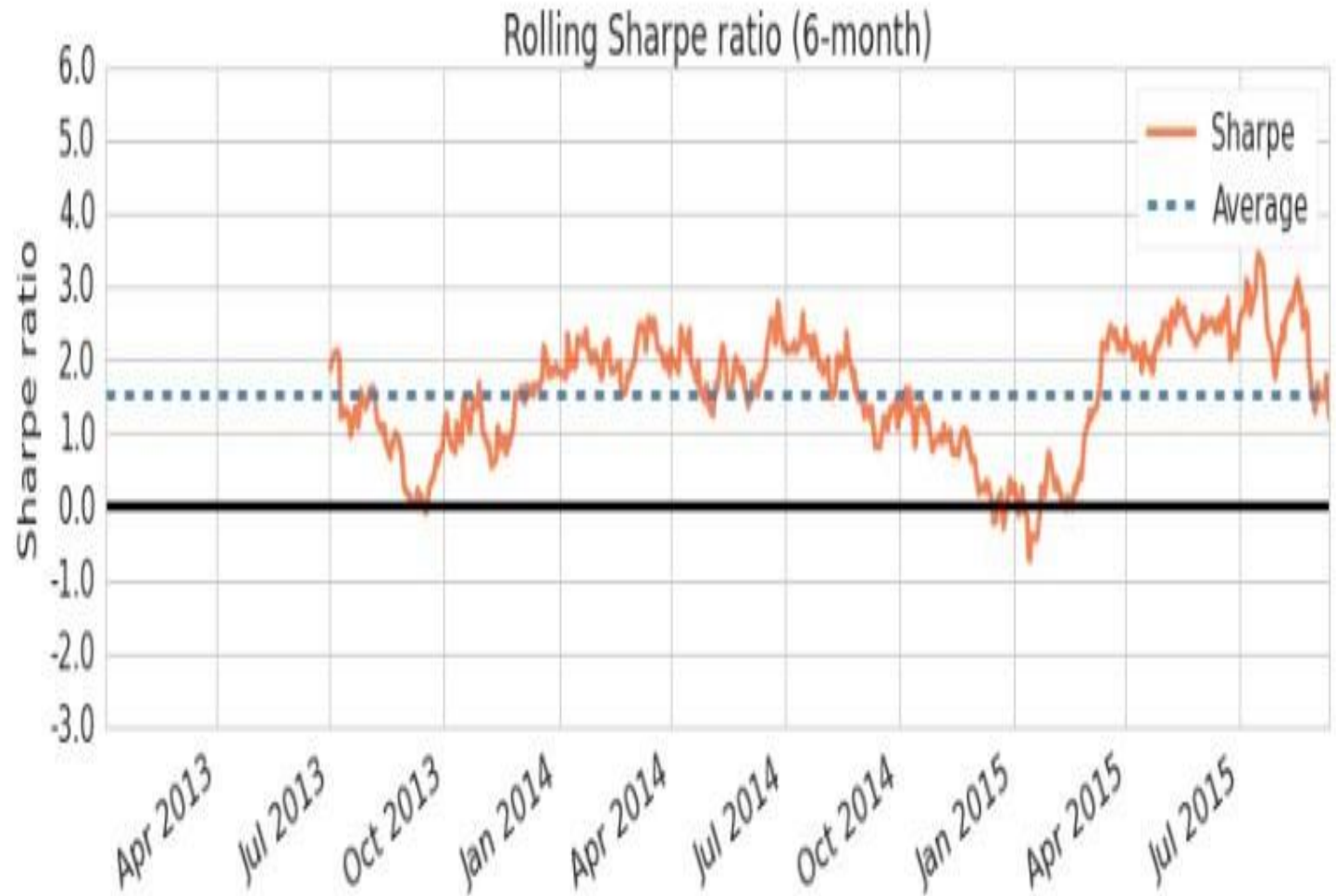
# CUMULATIVE RETURNS



# ROLLING PORTFOLIO BETA



# ROLLING SHARPE RATIO

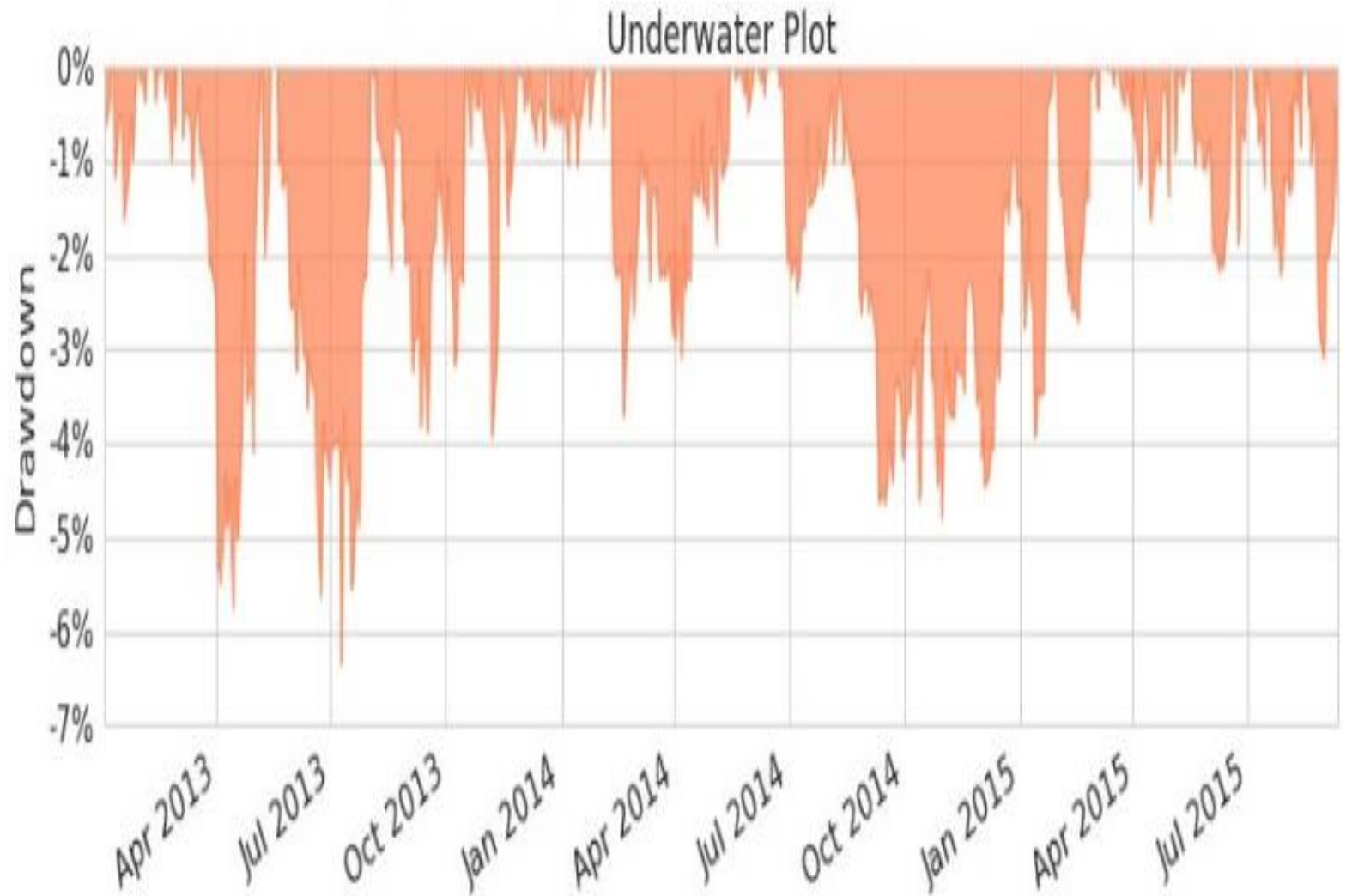




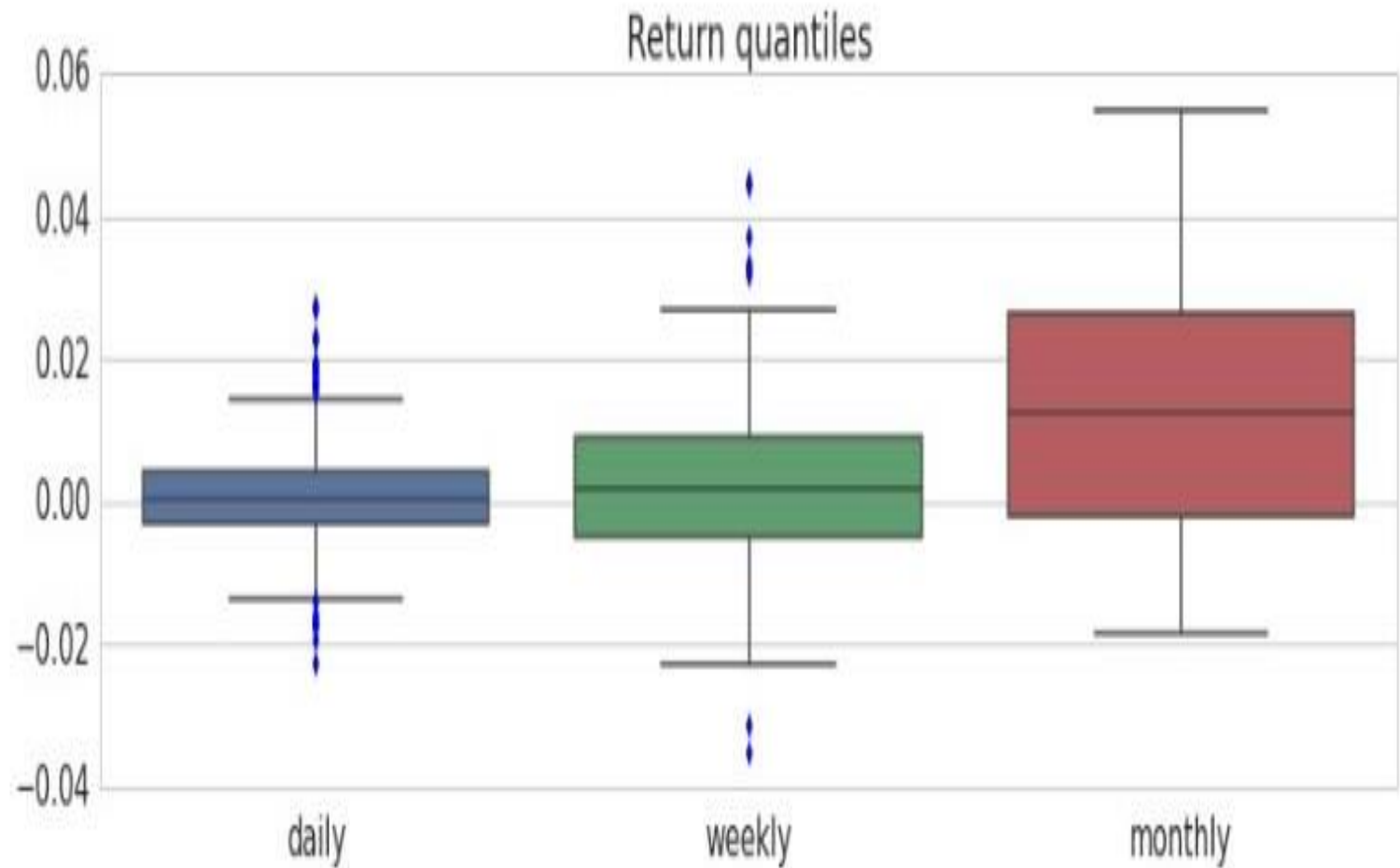
# FAMA-FRENCH



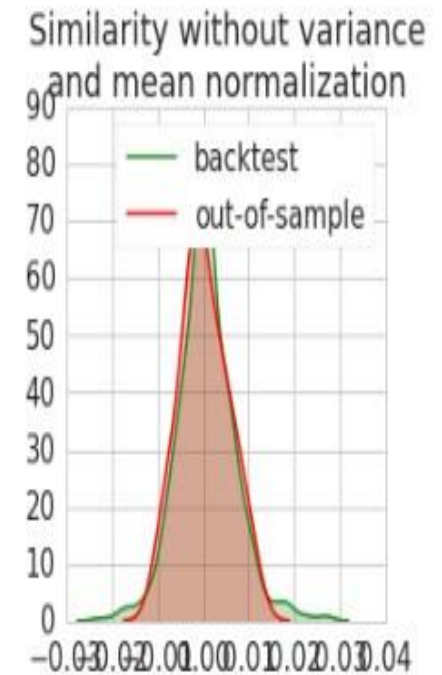
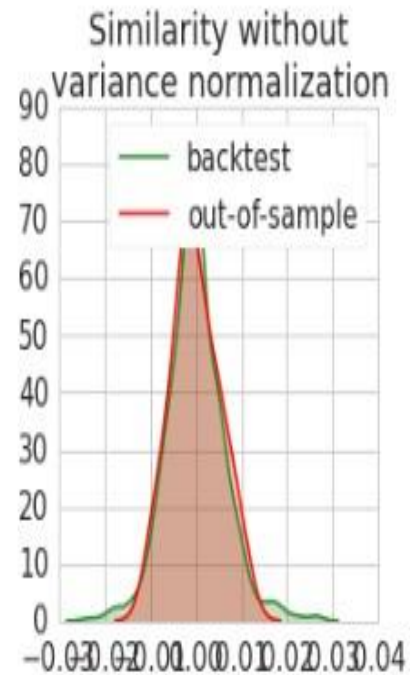
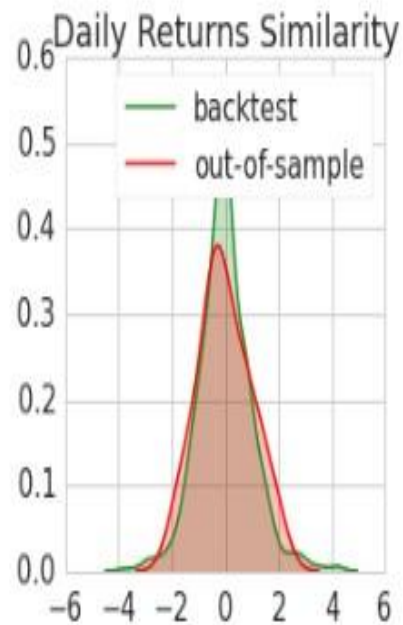
# UNDERWATER PLOT



# RETURN QUANTILES



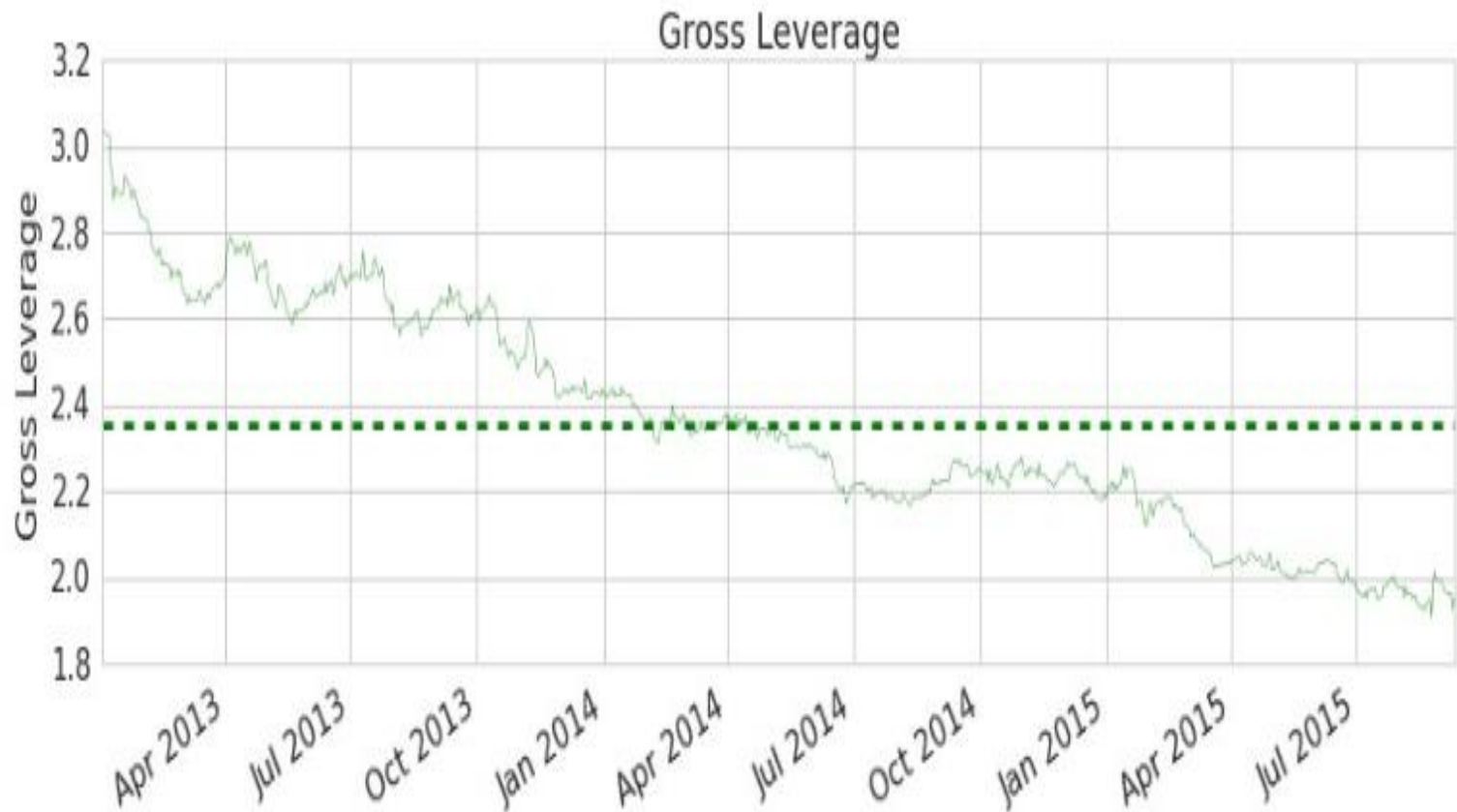
# STRESS EVENTS



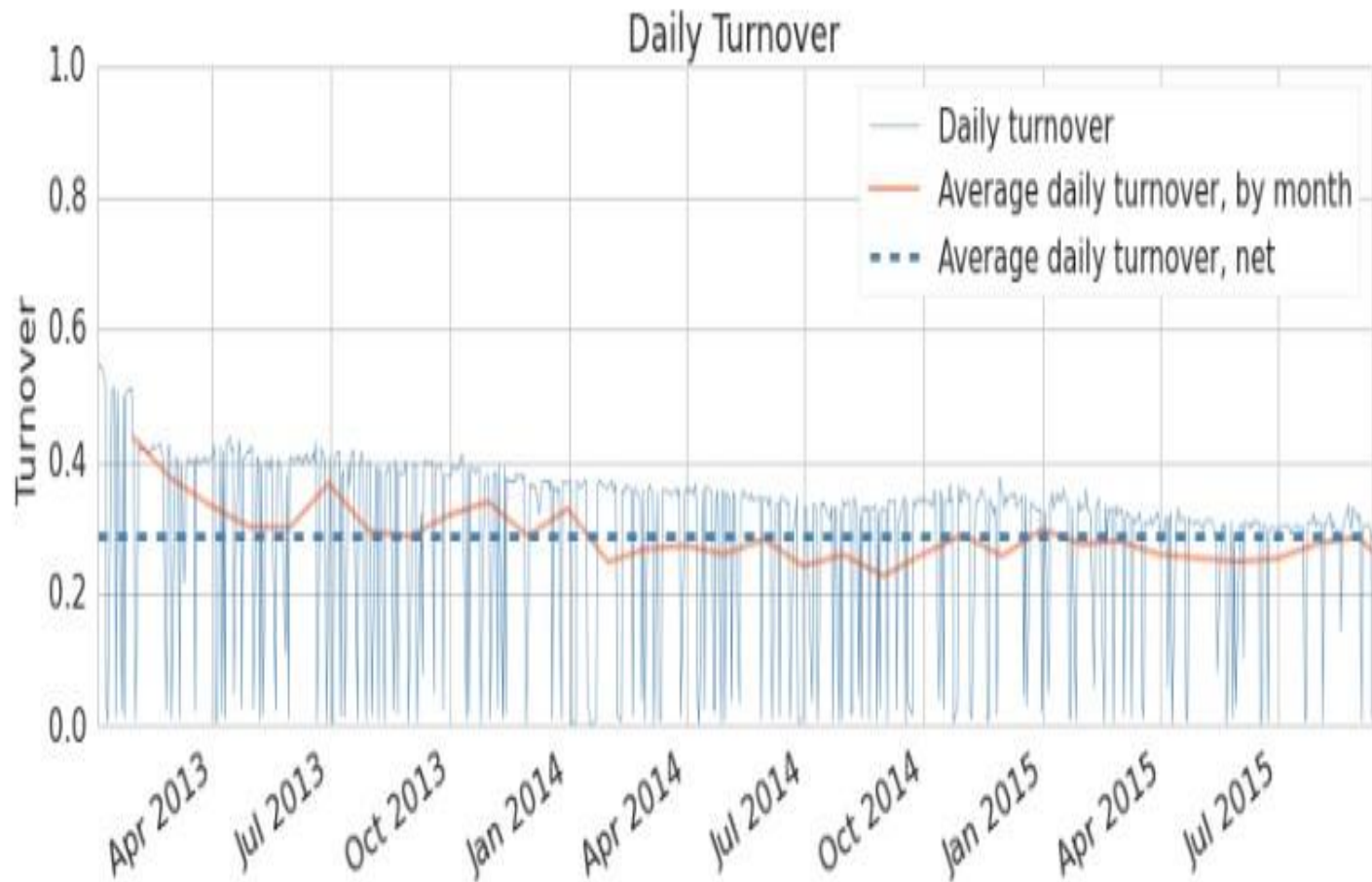
## Stress Events

	mean	min	max
Apr14	0.001	-0.011	0.011
Oct14	-0.000	-0.018	0.010
Fall2015	-0.000	-0.011	0.012

# GROSS LEVERAGE



# DAILY TURNOVER



# DAILY TRADING VOLUME



# АНАЛІЗ РЕЗУЛЬТАТІВ

- Спрощується процес обробки даних і їх аналізу. Викликані функції використовуються для аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів, вони допомагають у аналізі торгової стратегії і розраховують важливі для розуміння її ефективності показники.



# ВИСНОВКИ

- Була проведена робота по аналізу ефективності та ризиків фінансових портфелів, аналізу торгової стратегії на основі вхідних бектест даних. Створені сльозні листи , тобто таблиці і графіки аналітики портфеля , що дають нам показники, якими описується ефективність стратегії у чистому, витратному форматі.
- Проведено аналіз вхідних даних, результати роботи не гірше ніж в продуктах аналогах.



**ДЯКУЮ ЗА УВАГУ**