

Министерство образования и науки Российской Федерации

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ
ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ УЧРЕЖДЕНИЕ
ВЫСШЕГО ПРОФЕССИОНАЛЬНОГО ОБРАЗОВАНИЯ
«САРАТОВСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ИМЕНИ Н.Г. ЧЕРНЫШЕВСКОГО»

Кафедра Дискретной математики и
информационных технологий

ГЕНЕТИЧЕСКИЕ АЛГОРИТМЫ И ИХ ПРИМЕНЕНИЕ ДЛЯ ЗАДАЧ
ОПТИМАЛЬНОГО ПОРТФЕЛЬНОГО ИНВЕСТИРОВАНИЯ

КУРСОВАЯ РАБОТА

Студентки 2 курса 221 группы
направления 230100 — Информатика и вычислительная техника
факультета КНиИТ
Зыковой Анны-Марии Борисовны

Научный руководитель

Сагаева И.Д.

Заведующий кафедрой

Кандидат ф.-мат. наук

Тяпаев Л.Б.

Саратов 2016

Содержание

ОПРЕДЕЛЕНИЯ	3
ВВЕДЕНИЕ	4
1 оптимальное портфельное инвестирование	4
2	4
ЗАКЛЮЧЕНИЕ	4

ОПРЕДЕЛЕНИЯ

(переделать до последнего слова) Риск — одно из важнейших понятий, сопутствующих любой активной деятельности человека. Вместе с тем это одно из самых неясных и много- значных понятий. Однако во многих ситуациях суть риска хорошо пони- мается и воспринимается. Его содержание определяется той конкретной задачей, где данный термин используется. Общее понятие экономического риска, пожалуй, можно сформулиро- вать следующим образом: риск — это вероятность или угроза потери лицом или организаци- ей части своих ресурсов, части своих доходов, или появления дополнитель- ных расходов. Назовем некоторые виды рисков, связанные с экономической деятель- ностью человека. ● Инвестиционный — возникает за счет обесцени- вания инвестицион- но-финансового портфеля, состоящего из собственных и приобре- тенных ценных бумаг. ● Кредитный — обусловлен возможностью невыполнения обяза- тельств перед кредитором. ● Процентный — возникает за счет непредвиденного изменения про- центных ставок. ● Риск ликвидности — возникает за счет неожиданного изменения кредитных и депозитных пото- ков. ● Производственный — связан с возможностью невыполнения фир- мой своих обязательств перед заказчиком. ● Риск разорения — вероятность столь больших потерь, которые не могут быть компенсированы и ведут к разоре- нию конкретного лица или организации. Риски также подразделяются на: ● динамические — они связаны с непредвиденными изменениями сто- имости основного капитала вследствие управленческих решений, а также рыночных или политических обстоятельств; ● статические — такие риски связаны с воз- можностью потерь реаль- ных активов при нанесении ущерба собственности и потерь доходов из-за недееспособности организации.

ВВЕДЕНИЕ

- 1 Генетический алгоритм
- 2 Проблема выбора портфеля ценных бумаг
- 3 практика
- 4 господи, мне что, писать методич. пособие для использования?
- 5

ЗАКЛЮЧЕНИЕ