

АНОТАЦІЯ

Дипломну роботу виконано на 46 аркушах, вона містить 2 додатки та перелік посилань на використані джерела з 11 найменувань. У роботі наведено 10 рисунків.

Метою даної дипломної роботи є створення математичного та програмного забезпечення для автоматизації процесу прийняття інвестиційних рішень.

У роботі проведено аналіз існуючих рішень указаної задачі - статистичні методи (лінійна регресія, авторегресія) та нейронні мережі для прогнозування цінових коливань на фінансові інструменти та теорії оптимальних портфелів Марковіца і Тобіна. Виконано їх порівняння з погляду ефективності використання для фінансового ринку України. Для розв'язання задачі в роботі обрано методи регресійного аналізу та теорія оптимального портфеля Марковіца.

Розроблено автоматизовану систему, що реалізує даний метод. Виконано тестування розробленої системи.

Ключові слова: інвестиції, дефолт, $\cos \varphi$, прибутковість, ризик, портфель у розумінні Марковіца.

