

## АНОТАЦІЯ

Дипломну роботу виконано на 54 аркушах, вона містить 2 додатки та перелік посилань на використані джерела з 17 найменувань. У роботі наведено 12 рисунків та 5 таблиць.

Дана дипломна робота присвячена розробці математичної моделі для формування інвестиційного портфелю цінних паперів на основі моделі Марковіца.

В роботі виконано порівняльний аналіз існуючих математичних моделей для формування інвестиційного портфелю та методи оцінки фінансових інструментів, зокрема, розглянуто основні принципи сучасної портфельної теорії та розглянуто і проаналізовано моделі Марковіца, Шарпа, Шоулза-Блека та CAPM. Розглянуті методи оцінки ризику цінних паперів та інвестиційного портфеля. Запропоновано математичну модель на основі моделі Марковіца, в якому ризик оцінюється на основі моделі Value at risk.

Також в роботі розроблено програмне забезпечення, що реалізує отриману модель, та за його допомогою отримані основні характеристики портфелю.

Ключові слова: інвестиції, сучасна портфельна теорія, модель Марковіца, модель оцінки міри ризику Value at Risk.