

СПИСОК ВИКОРИСТАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

1. Жора Д. В. Принципы построения программного агента по торговле ценными бумагами / Д. В. Жора // Пробл. программирования. - 2004. - 2-3 [спец. вып.]. - С. 534-545.
2. Кукса М.Ю. Метод рекурентних співвідношень для оцінки інвестиційної привабливості активів / Кукса М.Ю., Норкін В.І. // XXV міжнародна науково-практична конференція «Развитие науки в XXI веке» — 1 часть, г. Харьков: сборник со статьями. — Х. : научно-информационный центр «Знание», 2017. — 104 с. — С. 88-92.
3. Мішура Ю.С. Математика фінансів / Мішура Ю.С., Шевченко Г.М. // Навчальний посібник. ВПЦ Київський університет, 2008. 352 с. — С. 164-200.
4. Markowitz H.M. Portfolio Selection / Harry M. Markowitz. // Journal of Finance. - 1952. - №7. – P.77-91.
5. Roy A.D. Safety first and the holding of assets / Roy A.D. // Econometrica. – 1952. – 20. – P. 431- 449.
6. Шарп У. Инвестиции / У. Шарп, Г. Александер, Дж.Бэйли. — М.: ИНФРА-М, 2001. — 1028 с.
7. Telser L.G. Safety first and hedging / Telser L.G. // Review of Economic Studies. –1955/56. – 23. – P. 1-16.
8. Kataoka S. A stochastic programming model / Kataoka S. // Econometrica. – 1963. – 31. – P. 181-196.
9. Bawa V.S. Safety first, stochastic dominance, and optimal portfolio choice / Bawa V.S. // J. of Financial and Quantitative Analysis. – 1978. – 13. – P. 255-271.
10. Arzac E. R. Portfolio choice and equilibrium in capital markets with safety first investors / Arzac E. R., Bawa V. S. // J. of Financial Economics. – 1977. – 4. – P. 277-288.

11. Li D., Safety-first dynamic portfolio selection / Li D., Chan T.F., Ng W.L. // *Dynamics of Continuous, Discrete and Impulsive Systems*. – 1998. – 4. – P. 585-600.
12. Jansen D.W. Portfolio selection with limited downside risk / Jansen D.W., Koedijk K.G., de Vries C.G. // *J. of Empirical Finance*. – 2000. – 7. – P. 247-269.
13. Goodall T. Adequate decision rules for portfolio choice problems / Goodall T. – New York: PALGRAVE, 2002. – 114 p.
14. Haque M. Safety-first portfolio optimization for US investors in emerging global, Asian and Latin American markets / Haque M., Hassan M. K., Varela O. // *Pacific-Basin Finance Journal* 2004. – 12. – P. 91-116.
15. Haque M. Safety-first and extreme value bilateral U.S. – Mexican portfolio optimization around the peso crisis and NAFTA in 1994 / Haque M., Varela O., Hassan M.K. // *The Quarterly Review of Economics and Finance*. 2007. – 47. – P.449-469.
16. Кибзун А.И. Оптимальное управление портфелем / Кибзун А.И., Кузнецов Е.А. // *Автоматика и телемеханика*. – 2001. – № 9. – С. 101-113.
17. Кибзун А.И. Позиционная стратегия формирования инвестиционного портфеля / Кибзун А.И., Кузнецов Е.А. // *Автоматика и телемеханика*. – 2003. – № 1. – С.151-166.
18. Кан Ю.С. Выбор портфеля с фиксированной доходностью / Кан Ю.С., Краснопольская А.Н. // *Автоматика и телемеханика*. – 2006. – № 4. – С. 97-104.
19. Григорьев П.В. Оптимальное управление инвестиционным портфелем по отношению к квантильному критерию / Григорьев П.В., Кан Ю.С. // *Автоматика и телемеханика*. – 2004. – № 2. – С. 179-197.
20. Kan Yu.S. Application of the Quantile Optimization to Bond Portfolio Selection / Kan Yu.S. // *Stochast. Optim. Techniques: Numerical Methods and Technical Appl.*, K. Marti, Ed. – Berlin: Springer, 2002. – 513. – P. 285–308.
21. Kibzun A.I. Stochastic programming problems with probability and quantile Functions / Kibzun A.I., Kan Y.S. — Chichester, New York, Brisbane, Toronto, Singapore: John Wiley & Sons, 1996. – 301p.

22. Kibzun A.I. Discrete Approximation in Quantile Problem of Portfolio Selection / Kibzun, A.I. and Lepp, R., // Stochastic Optimization: Algorithms and Applications, S. Uryasev and P.M. Pardalos, Eds. – Dordrecht: Kluwer, 2001. – P. 119-133.

23. Норкин В.И. Оптимизация финансового портфеля на основе принципа безопасности / Норкин В.И., Бойко С.В. // Кибернетика и системный анализ. – 2012. - № 2. – С.29-41.

24. Shapiro A. Lectures on stochastic programming: Modeling and theory / Shapiro A., Dentcheva D., Ruszczyński A. - SIAM, Philadelphia, 2009. – 436 p.

25. Raik E. On the Stochastic Programming Problem with the Probability and Quantile Functionals / Raik E. // Изв. АН ЭССР, Физика-Матем. – 1972. – 21, № 2. – P. 142-148

26. Norikin V. Global optimization of probabilities by the stochastic branch and bound method / Norikin V. // Stochastic optimization: Numerical methods and technical applications, Lecture Notes in Economics and Mathematical Systems 458. – Berlin: Springer, 1998. – P.186-201.

27. Markowitz H.M. Portfolio selection. Efficient diversification of investments / Markowitz H.M. – New York: John Wiley & Sons, London: Chapman & Hall, 1959. – 344 p.

28. Ермольев Ю. М.. Методы стохастического программирования / Ермольев Ю. М.. – М.: Наука, 1976. – 240с.

29. Ruszczyński A. Stochastic Programming / Ruszczyński A., Shapiro A., Eds. // Amsterdam: Elsevier, 2003. – 688 p.

30. Kuksa M.U. Numerical calculation of a distribution for the asset price minimum under the binomial asset price model / Kuksa M.U., Norikin V.I. // System analysis and information technology: 19-th International conference SAIT 2017, Kyiv, Ukraine, May 22-25, 2017. Proceedings. – ESC “IASA” NTUU "Igor Sikorsky Kyiv Polytechnic Institute", 2017. – P.136.