

# Система оптимизации фондового портфеля. Теория и практика

Презентация обучающего семинара

Недосекин Алексей Олегович,  
руководитель проекта, к.т.н.  
«Сименс Бизнес Сервисез»

# Содержание

1. Основы теории портфельной оптимизации (1 час)
2. Оптимизация модельного фондового портфеля (1 час)
3. Оценка инвестиционной привлекательности реальных активов (1 час)
4. Прогнозирование фондовых индексов (1 час)
5. Выполнение практических работ с использованием системы оптимизации фондового портфеля (2-3 часа)

# 1. Основы теории портфельной оптимизации

- 1.1. Винеровская модель доходности и риска фондовых активов
- 1.2. Корреляционная матрица и ее роль в оптимизации
- 1.3. Классическая задача оптимизации портфеля по Марковицу
- 1.4. Проблемы классической теории

## 2. Оптимизация модельного фондового портфеля

- 2.1. Модельные классы и индексы
- 2.2. Текущая и финальная (конечная) доходность
- 2.3. Нечеткая модель конечной доходности активов
- 2.4. Нечеткая постановка задачи по Марковицу
- 2.5. Типичные случаи моделирования

## 3. Оценка инвестиционной привлекательности реальных активов

- 3.1. Матричные методы комплексной оценки активов
- 3.2. Рейтинг обязательств субъектов РФ
- 3.3. Скоринг акций
- 3.4. Рейтинг корпоративных облигаций
- 3.5. Схема Фишберна оптимизации реального портфеля

## 4. Прогнозирование фондовых индексов

- 4.1. Введение в проблему прогнозирования
- 4.2. Модели рационального инвестиционного поведения
- 4.3. Модели прогнозирования

## 5. Практические работы

- 5.1. Оптимизация модельного портфеля
- 5.2. Оптимизация портфеля на реальных активах
- 5.3. Создание прогноза

## Контактная информация

Недосекин Алексей Олегович, руководитель проекта  
«Система оптимизации фондового портфеля», к.т.н.

[Alexey.Nedosekin@siemens.com](mailto:Alexey.Nedosekin@siemens.com)

[http://sedok.narod.ru/sc\\_group.html](http://sedok.narod.ru/sc_group.html)

(812) 331-03-93