

УДК 330.131.7(075)

«Информационное и программное обеспечение количественной оценки
экономических и финансовых рисков»

МАЛГАЖДАРОВА ГУЛЬНАРА АМАНГАЗИЕВНА

6N0703- Информационные системы

Реферат

Структура диссертационной работы определена задачами и логикой исследования и состоит из введения, трех глав, заключения, списка использованной литературы и приложений.

Объем диссертации составляет 95 страниц машинного текста. В тексте диссертационного исследования содержится 17 рисунков, 12 таблиц, 4 приложения. Список использованной литературы включает в себя 30 наименований источников.

Ключевые слова: ФИНАНСОВЫЙ РИСК, ЭКОНОМИЧЕСКИЙ РИСК, ИНВЕСТИЦИИ, КЛАССИФИКАЦИЯ РИСКОВ, МАРКОВИЦ, ОПТИМАЛЬНЫЙ ПОРТФЕЛЬ, КОЛИЧЕСТВЕННАЯ ОЦЕНКА РИСКОВ, МОДЕЛЬ, ПРОДУКЦИЯ, ПОРТФЕЛЬ, ДИВЕРСИФИКАЦИЯ.

В ходе диссертационного исследования была разработана информационная система оценки рисков инвестиционных вложений в условиях неопределенности с помощью модели марковица. Марковиц рассматривал однопериодную стратегию управления портфелем в предположении гауссовского распределения приращений рыночных цен. Данная работа посвящена решению многопериодных задач оптимизации инвестиционного портфеля.

Предложенные постановки отличаются многошаговостью стратегии управления и выбором нового типа ограничений на максимальные потери стоимости инвестиций внутри периода управления.

Предметом исследования является разработка информационного и программного обеспечения для количественной оценки экономических и финансовых рисков с целью повышения эффективности принятия решения в условиях неопределенности.

Программное обеспечение реализовано на языке Borland Delphi 7.0. При разработке баз данных была использована СУБД MS Access.

UDC 330.131.7(075)

«Information and software of the quantitative estimation economic and financial risk»

MALGAZH DAROVA GULNARA

6N0703- Information system

Abstract

Structure of the dissertation research defines the tasks and logic of the study and consists of an introduction, three chapters, conclusion, bibliography and appendices.

Volume of the dissertation is 95 pages of typewritten text. The text of the dissertation research contains 17 pictures, 12 tables, 4 appendices. Bibliography includes 30 kinds of sources.

Key words: FINANCIAL RISK, ECONOMIC RISK, INVESTMENTS, CATEGORIZATION RISK, MARCOVIC, OPTIMUM BRIEFCASE, QUANTITATIVE ESTIMATION RISK, MODEL, PRODUCT, BRIEFCASE, DEVESIFICATION.

During the dissertation research was carried out the development of information system of the estimation risk investment embedding in condition of the uncertainties by means of Markovic models. Markovic considered one periodic strategy of briefcase management. Given work is dedicated to decision more periodic problems to optimization of the investment briefcase.

The subject of research is to develop an information and software for quantitative estimation economic and financial risk for the reason increasing of efficiency decision making in condition of the uncertainties

Software is implemented in the language of Borland Delphi 7.0. In developing the database was used DBMS MS Access.

ӘОЖ 330.131.7(075)

«Экономикалық және қаржылық қауіпті сандық сараптаудың
ақпараттық және бағдарламалық қамтамасыз ету»

МАЛГАЖДАРОВА ГҮЛНАРА

6N0703- Ақпараттық жүйелер

Реферат

Диссертациялық зерттеу құрылымы тапсырмалармен және зерттеу логикасымен айқындалған және кіріспеден, үш бөлімнен, қорытындыдан, пайдаланылған әдебиеттер тізімінен және қосымшадан тұрады.

Диссертация көлемі 95 бет машинамен жазылған мәтіннен тұрады. Диссертациялық зерттеу мәтінде 17 сурет, 12 кесте, 4 қосымша бар. Пайдаланылған әдебиеттер тізіміне 30 деректер атауы енеді.

Түйін сөздер: ҚАРЖЫЛЫҚ ҚАУІП, ЭКОНОМИКАЛЫҚ ҚАУІП, ИНВЕСТИЦИЯЛАР, ҚАУІПТЕРДІҢ ЖІКТЕЛУІ, МАРКОВИЦ, ТИІМДІ ПОРТФЕЛЬ, ҚАУІПТІҢ САНДЫҚ САРАПТАМАСЫ, УЛГІ, ӨНІМ, ПОРТФЕЛЬ, ДИВЕРСИФИКАЦИЯ.

Диссертациялық зерттеу барысында Марковиц үлгісінің көмегімен белгісіздік жағдайында инвестициялық пай қорының қауіпінің сандық сараптамасын жасайтын ақпараттық жүйе құрылды. Марковиц портфельді басқарудың бір айналымды стратегиясын қарастырған. Диссертациялық жұмыс инвестициялық портфельді тиімдеудің көп айналымды есебін шешуге арналған.

Берілген шарттар басқару айналымы ішіндегі инвестициялық құнды максималді жоғалтуына деген шектеулердің жаңа түрін таңдау мен басқарудың көп қадамдылық стратегиясымен айқындалады.

Белгісіздік ағдайында инвестициялық шешім қабылдауды тиімділеу мақсатында экономикалық және қаржылық қауіптілікті санды сараптауды ақпараттық және бағдарламалық қамтамасыз ету зерттеу пәні болып табылады.

Ақпараттық және бағдарламалық қамтамасыз ету Borland Delphi 7.0. тілінде жүзеге асырылды. Мәліметтер базасын жасау кезінде МББЖ MS Access қолданылды.