

Аннотация

Состав диссертации: 63 страницы текста, 17 рисунков, 3 таблицы, 4 приложения, библиография (55 источников)

Ключевые слова: метод рандомизированных траекторий, рисковый капитал, Value-at-Risk, комбинаторная модель распределения экономических ресурсов, алгоритм генерации композиций SWIFT, стохастический процесс со степенными реализациями.

В данной работе была показана возможность использования метода рандомизированных траекторий с использованием стохастического процесса со степенными реализациями для оценки меры риска Value-at-Risk. Была показана возможность использования комбинаторной модели распределения экономических ресурсов с использованием неполной, неточной и нечисловой информации для оценки меры риска Value-at-Risk. Сделаны выводы о преимуществах и недостатках этих подходов.