

РАВНОВЕСНЫЕ ПОРТФЕЛЬНЫЕ СТРАТЕГИИ

В.В. Давнис, Е.А. Хлебникова

Предлагается методика построения портфелей ценных бумаг со структурой оптимальной относительно равновесных значений средней доходности. Проведено сравнение портфелей, построенных в соответствии с классической схемой и предлагаемой методикой. Результаты вычислительного эксперимента показали преимущество этой методики.