



## **Институт по Информационни и Комуникационни Технологии –БАН**

### **Научен семинар по**

*Паралелни алгоритми и научни пресмятания*

На 08 януари 2013 г. (вторник) от 14 часа в зала 218 на бл. 25А на ИИКТ- БАН **проф. Иван Иванов** от Стопански факултет, СУ „Св. Климент Охридски“, ще изнесе доклад на тема:

### **Моделиране на инвестиции във финансови портфейли и числени методи**

**Абстракт.** Докладът разглежда модел за оптимално управление на една стохастична система, моделирана чрез стандартно Брауново лутане (Винеров процес). Моделът се прилага за управление на инвестициите в портфейл от различни видове акции, търгувани на даден финансов пазар. За намиране на оптималното управление в модела се налага да се пресметне максималното решение на обобщено непрекъснато Рикатиево уравнение.

Акценти на доклада:

- числени методи за пресмятане на максималното решение на обобщеното Рикатиево уравнение;
- практическа интерпретация на модела: компютърни симулации;
- трудности при реализацията на модела.