

dr Maria Górniołek
Uniwersytet Śląski w Katowicach, Instytut Matematyki

Portfele akcji z osobliwą macierzą kowariancji

W referacie zostanie przedstawiony problem wyboru najlepszego portfela akcji (portfela efektywnego) w przypadku, gdy macierz kowariancji stóp zwrotu akcji wchodzących w skład portfela jest osobliwa. Rozwiązanie problemu opiera się na analizie wartości i wektorów własnych macierzy kowariancji. Zostanie również pokazane zastosowanie macierzy pseudoodwrotnej Moore'a–Penrose'a oraz rozwiązania minimalnego układu równań liniowych do wyznaczania portfela efektywnego.