

VILNIAUS UNIVERSITETAS
MATEMATIKOS IR INFORMATIKOS FAKULTETAS

Bakalauro baigiamasis darbas

Uodegos priklausomybe pasižyminčio
portfelio rizikos pasiskirstymo funkcijos režiai

Distributional Bounds for Portfolio Risk with Tail
Dependence

Darius Žebrauskas

VILNIUS 2016

VILNIAUS UNIVERSITETAS
MATEMATIKOS IR INFORMATIKOS FAKULTETAS

Bakalaurinis darbas

**Portfelio su prekybos kaštais optimizavimas
CRR modelyje**

**Portfolio optimization under trading costs in CRR
model**

Indrė Markevičiūtė, Ieva Vareikaite

VILNIUS 2017

MATEMATIKOS IR INFORMATIKOS FAKULTETAS
MATEMATINĖS ANALIZĖS KATEDRA

Darbo vadovas Doc. Martynas Manstavičius _____

Darbo recenzentas Prof. Jonas Šiaulys _____

Darbas apgintas _____

Darbas įvertintas _____

Registravimo NR. _____

Atidavimo į katedrą data _____