

ОЦЕНКА ВЕЛИЧИНЫ НЕОБХОДИМОГО РАЗНООБРАЗИЯ ПРИ ДИВЕРСИФИКАЦИИ ПОРТФЕЛЯ ИНВЕСТИЦИЙ

М.К.Базаров

Аннотация: В работе представлена попытка количественной оценки величины необходимого разнообразия при диверсификации портфеля инвестиций на основе отношения вариаций эффективности портфеля с учётом наличия линейных корреляционных связей между его составляющими.

КЛЮЧЕВЫЕ СЛОВА: ДИВЕРСИФИКАЦИЯ, РАЗНООБРАЗИЕ, ВАРИАЦИЯ, ДИСПЕРСИЯ, КОРРЕЛЯЦИЯ, ВЕРОЯТНОСТЬ, РЕНТАБЕЛЬНОСТЬ, СЕБЕСТОИМОСТЬ, РИСК

**NECESSARY VARIETY VALUE ESTIMATION WHILE PORTFOLIO
DIVERSIFICATION**

M.K.Bazarow

Annotation: Quantity estimation attempt of necessary variety value while investment portfolio diversification is presented in this paper. It is made on the basis of ratio variations of portfolio efficiency taking in consideration linear correlation connections links of its components.

**Key words: DIVERSIFICATION, VARIETY, VARIATION, DISPERSION,
CORRELATION, PROBABILITY, PROFITABILITY, COST, RISK.**