**Тема: Параметрическая модель *VaR.***

Вопросы:

1. Абсолютный и относительный *VaR.*
2. Оценка ошибки параметрической модели *VaR*.
3. Ожидаемые потери портфеля в случае превышения значения *VaR*.
4. Решение задач

Рекомендуемая литература:

1. А.П.Иванов. Финансовые инвестиции на рынке ценных бумаг. М.: Дашков и К, 2008. – 480 с.
2. Бочаров В.В. Инвестиционный менеджмент (управление инвестициями): Учебное пособие. – С-Пб.: Издательство С-ПбУЭФ, 2000;
3. Касимов Ю. Ф. Введение в теорию оптимального портфеля ценных бумаг. – М.: Анкил, 2005. – 144 с.
4. Буренин А.Н. Управление портфелем ценных бумаг. – М.: Научно-техническое общество имени академика С.И. Вавилова, 2007. – 404 с.
5. Шапкин А. С., Шапкин В. А. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг. – М.: Дашков и Ко, 2010. – 512 с.

Вопросы для самоконтроля:

1. Что означает показатель VAR?
2. Параметрические и непараметрические модели VAR.
3. Диверсифицированный и недиверсифицированный VAR.
4. Что означает показатель EaR?