**Тема: Оценка эффективности управления портфелем ценных бумаг.**

Вопросы:

1.Оценка доходности и риска.

2. Показатели эффективности управления портфелем: коэффициенты Шарпа, Трейнора и эффективности портфеля облигаций, индекс Дженсена, индекс Модильяни.

3.Показатели способности менеджера прогнозировать доходности активов и конъюнктуру.

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. Раскрыть экономическое содержание оценки эффективности управления портфелем ценных бумаг
2. Назовите показатели эффективности управления портфелем ценных бумаг.
3. Чем вызвана необходимость пересмотра портфеля ценных бумаг?
4. Чем вызвана необходимость оценки эффективности управления портфелем ценных бумаг?
5. Что является первичной задачей оценки эффективности управления портфелем ценных бумаг?