**Тема: Ожидаемая доходность и риск портфеля ценных бумаг.**

Вопросы:

1.Ожидаемая доходность портфеля.

2.Ожидаемый риск портфеля.

3.Портфель, состоящий из актива без риска и рискованного актива. Кредитный и заемный портфели.

4.Решение задач (выписать все формулы из лекционного комплекса, тема 3).

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 такое риск?
  2. Каким видам рискам подвержен рынок ценных бумаг?
  3. Назовите способы оценки риска при формировании портфеля.
  4. Что Вы понимаете под волатильностью рынка?
  5. Назовите современные модели оценки риска.