Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ашмарина Светлана Игоревна
Должность: Ректор ФГБОУ ВО «Самарский государственный экономический университет»
Дата подписания: 22.04.2021 10:26:03
Уникальный программный ключ:
5965002480a5bbaa475b8b6e74ea4159b9621fcf927a851180ab

ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ

5.1. Вопросы для зачета

1.Основные подходы к изучению динамики рынка
2.Сравнительные характеристики технического фундаментального анализа
3.Фундаментальный анализ: сущность, методы, достоинства и недостатки
4.Показатели ликвидности и платежеспособности.
5.Показатели финансовой устойчивости и финансовой независимости компании
6.Качественный анализ управления предприятия
7.Показатели эффективности деятельности предприятия
8.Оценка инвестиционной привлекательности акций
9.Критерии, используемые в фундаментальном анализе для отбора акций
10.Критерии инвестирования в облигации
11.Факторы, влияющие на курсовую стоимость облигаций
12.Рейтинг ценных бумаг. Крупнейшие рейтинговые агентства.
13.Эффективная граница портфеля
14.Определение набора эффективных портфелей
15.Модель оценки стоимости активов
16.Определение рыночного портфеля
17.Определение оптимального портфеля
18.Стратегия постоянной пропорции между классами активов
19.Функции полезности инвесторов
20.Кредитные и заемные портфели
21.Правовое регулирование портфельного инвестирования
22.Основные регуляторы рынка портфельного инвестирования
23.Премия за риск Марковица
24.Максимизация количества стандартных отклонений между доходностью портфеля и целевым уровнем.
25.Абсолютный и относительный VAR
26.Рыночный анализ активов: альфа и бета коэффициенты.
27.Рыночная информация о финансовых инструментах.
28. Понятие курса Банка России
29. Капиталоемкость финансового рынка и ее виды.
30. Биржевая инфраструктура и институциональные риски.