

Темы докладов

1. Модели математического и банковского дисконтирования.
2. Денежные потоки и методы их оценки.
3. Оценка наращенной суммы потока платежей. Современная величина потока платежей.
4. Оценка уровня диверсификации и ее влияния на волатильность портфеля активов.
5. Максимумный критерий крайнего оптимизма. Максимумный критерий Вальда.
6. Обобщенный критерий пессимизма-оптимизма Гурвица.
7. Оценка доходности и волатильности ценной бумаги.
8. Определение оптимальной структуры рискового портфеля. Модели Марковица и Тобина.
9. Фундаментальный анализ. Факторы, влияющие на движение цен на финансовых рынках.
10. Основные понятия о моделях нестационарных процессов с конечным числом параметров.
11. Дисконтная ставка и некоторые проблемы ее определения и использования.
12. Методика RiskMetrics.
13. Теория экстремальных значений (EVT) и ее применение для оценки финансовых рисков.
14. Когерентные меры риска.
15. Развитие моделей выбора в условиях риска и неопределенности.
16. “Equitypremiumpuzzle” и теория проспектов.
17. Оценка деривативов методом конечных разностей.
18. Оценка опционов методом Монте-Карло: проблемы и подходы.
19. Практические аспекты хеджирования деривативами: проблемы и преимущества.
20. Современные практически-ориентированные модели кредитного риска.
21. Процентные деривативы: модели и методы оценки.