# 

# **Тема 4: Модели и методы оценки активов**

**Вопросы для обсуждения:**

1. Характерные признаки финансовых активов
2. Цель и задачи управления портфелем финансовых активов. Последовательность действий инвестора по формированию портфеля финансовых активов
3. Типы портфелей ценных бумаг. Процедура управления портфелем ценных бумаг.
4. Модель оценки доходности финансовых активов
5. Теория арбитражного ценообразования.
6. Теория ценообразования опционов

**Рекомендуемая литература:**

1. Бланк И.А. Финансовый менеджмент: Учебный курс. - К.: Ника-центр, 1999.

2. Глухов В.В., Бахрамов Ю.М. Финансовый менеджмент / Учебное пособие - СПБ: Специальная литература. Санкт-Петербург, 2004.

3. Ковалев В.В. Введение в финансовый менеджмент. - М.: Финансы и статистика, 2000г

4. Крейнина М.Н. Финансовый менеджмент. - М.:ДИС, 2004.

5. Сапарова Б. Финансовый менеджмент.- Алматы,2008

**Контрольные вопросы:**

1. В чем выражается рисковость операций с финансовыми активами?
2. Как может быть измерена результативность операций с финансовыми активами?
3. Можно ли управлять величиной несистематического риска?
4. Что такое β – коэффициент?
5. Прокомментируйте экономический смысл модели САРМ.