

Методические рекомендации по выполнению самостоятельной работы.

Домашняя работа состоит из трёх частей.

1 часть. Формирование портфеля облигаций с заранее определёнными характеристиками. Студентами самостоятельно определяются цели, задачи и характеристики портфеля облигаций. При этом внимание следует уделить следующим аспектам:

- четкости формулировок при определении цели и соответствие итоговой структуры портфеля поставленным задачам;
- степени диверсификации портфеля;
- степени соответствия выбранных активов поставленным целям;
- обоснованию весов каждого актива в портфеле;
- обоснованию включения каждого актива в портфель;
- итоговым характеристикам портфеля.

Студенты должны презентовать полученные результаты.

2 часть. Формирование портфеля акций по модели Марковица.

При этом внимание следует уделить следующим аспектам:

- постановке цели и формулировке задач;
- обоснованию степени диверсификации портфеля;
- обоснованию включения каждого актива в портфель;
- итоговым характеристикам портфеля.

Студенты должны презентовать полученные результаты.

3 часть. Формирование дивидендного портфеля.

При этом внимание следует уделить следующим аспектам:

- постановке цели и формулировке задач;
- обоснованию количества активов в портфеле;
- обоснованию включения каждого актива в портфель;
- итоговым характеристикам портфеля.

Студенты должны презентовать полученные результаты.

Студенты информируются о домашнем задании на первом семинаре по данной дисциплине. Домашнее задание рекомендуется выполнять по мере освоения материала. Выполнение задания групповое. Студентам следует уделить существенное внимание презентации материалов, качеству презентации и качеству информации, представленному в презентационных материалах. Все материалы прикрепляются в Smart LMS до даты презентации результатов самостоятельной работы.