# Задание №1: Расчет VaR

# Выбрать 3 рыночных инструмента:

* + одну из расчетных валют (доллар, евро, фунт, йена, швейцарский франк);
  + инструмент фондового рынка (ценную бумагу);
  + инструмент товарного рынка (золото, нефть, пшеница…)

# Скачать котировки за 5 лет

# Рассчитать VaR и RORAC выбранных инструментов с использованием исторического и параметрического методов.

# Оценить применимость параметрического метода с использованием критериев согласия.

# Провести содержательный анализ динамики изменений показателей рисков, нацеленный на выявление факторов, влияющих на показатели рисков, в т.ч. макроэкономических и политических факторов, факторов конъюнктуры финансовых рынков и рыночного сегмента, факторов внутреннего состояния компании (финансовых и нефинансовых).

# Для проведения расчетов написать код на Python/. Там же представить сравнительный анализ динамики показателей рисков, нацеленный на выявление внешних и внутренних факторов, влияющих на волатильность показателей.

# Назвать файл: «VaR\_ФИ\_група\_версия i»

# Выложить файл на ресурс в папку «Задание\_VaR\_»

9. Для получения бонусных баллов к экзамену: Придумать и реализовать в виде ПО игровую ситуацию по оценке VaR на основе рыночных котировок.