

Примерные вопросы при защите расчетно-графической работы:

- опишите порядок подготовки исходной информации для расчета по Вашему варианту РГР
- перечислите эмитентов, акции которых входят в Ваш портфель акций
- как определяются цены приобретения акций?
- как определяется количество приобретенных Вами акций?
- какое время удержания акций выбрано для расчета?
- каков период исторического моделирования в Вашем расчете?
- как определяются возможные в будущем (гипотетические) отклонения цен на акции?
- как определяются варианты будущей (гипотетической) стоимости Вашего портфеля акций?
- как определяются возможные в будущем (гипотетические) отклонения в стоимости гипотетического портфеля?
- каким образом ранжируются данные о гипотетических отклонениях стоимости портфеля?
- как на основе ранжированных данных о гипотетических отклонениях стоимости портфеля получить величину расчетного резерва под потери?
- в каких единицах измеряется величина Вами полученного резерва?
- растет или уменьшается величина резерва с ростом требований к надежности?
- можно ли с помощью Вашего расчета в РГР получить ответ о резервах для любого уровня надежности?
- что, если в Вашем портфеле будет не два, а три или четыре вида акций – как изменится алгоритм расчета?
- что, если в некоторые дни торги по некоторым видам активов не проводились – как в этом случае применять метод исторического моделирования?
- можно ли применять метод исторического моделирования в кризисных ситуациях?
- как будет меняться алгоритм расчета в зависимости от изменения времени удержания акций?
- почему применяемый Вами метод расчета был назван методом исторического моделирования?