**3.1 Вопросы к зачету по учебной дисциплине**

**«Анализ финансовых инструментов»**

1. Содержание, цели и основные положения фундаментального анализа финансовых инструментов
2. Концепция справедливой стоимости активов.
3. Концепция информационной эффективности финансового рынка.
4. Инвестиционные характеристики финансового инструмента: риск, доходность, ликвидность, волатильность.
5. Ликвидность финансового инструмента и показатели ее оценки.
6. Измерение волатильности и риска на финансовом рынке. Коэффициент бета.
7. Стоимостная оценка акций.
8. Особенности оценки стоимости облигаций с учетом риска. Дюрация.
9. Макроэкономический анализ
10. Индикаторы макроэкономического анализа, их классификация.
11. Монетарные индикаторы, процентные ставки денежного рынка и рынка капитала, ВВП и экономические индикаторы, индексы деловой активности, индикаторы рынка труда, индексы рынка ценных бумаг.
12. Отраслевой анализ в экономической науке. Отрасли и виды экономической деятельности в Республике Беларусь, их характеристика.
13. Количественные показатели отраслевого анализа. Оценка инвестиционной привлекательности в отрасли.
14. Анализ финансового состояния эмитента и выявление тенденций его изменения.
15. Анализ структуры баланса и выявление степени его ликвидности.
16. Методы инвестиционной оценки стоимости акции.
17. Мультипликаторы, принципы их построения и значение в фундаментальном анализе.
18. Сравнительный анализ активов, мультипликатор P/E.
19. Мультипликаторы на основе финансовых результатов компании, мультипликаторы на основе балансовой оценки активов.
20. Натуральные мультипликаторы в фундаментальном анализе, их значение.
21. Сущность технического анализа, его история и постулаты.
22. Тренды, их виды. Графики в техническом анализе, их виды и способы построения. Характеристики тренда.
23. Уровни в техническом анализе и их классификация. Поддержка и сопротивление. Торговля по уровням.
24. Канал, его применение в торговле.
25. Графические модели и их виды.
26. Модели продолжения тенденции.
27. Модели разворота.
28. Применение математических методов в техническом анализе. Классификация индикаторов и осцилляторов, их применение.
29. Скользящее среднее (Moving Average), его значение в техническом анализе.
30. Осциллятор «индекс относительной силы» RSI (Relative Strength Index,).
31. Циклы и их классификация. Основные принципы циклического анализа.
32. Волновая теория Эллиотта. Основные принципы волновой теории Эллиотта. Структура и соотношение волн в теории Эллиотта.
33. Торговые системы и их классификации. Структура торговой системы и ее построение.
34. Управление рисками в торговле финансовыми инструментами. Управление размером открываемой позиции. Оценка эффективности торговли.