

Отчет за первый семестр обучения магистранта
Гедранович Ольги Брониславовны
Специальность: 1-25 05 03 «Финансы, денежное обращение и кредит»,
заочная форма обучения

За прошедший семестр (октябрь 2006 - март 2007 г.):

1. Была сформулирована и утверждена тема магистерской диссертационной работы «**Адаптивные процедуры оценивания параметров в управлении портфелем ценных бумаг**», и назначен научный руководитель – Хацкевич Г.А., д.э.н., профессор.
2. Посещались занятия по дисциплинам учебного плана: «Философия и методология науки», «Английский язык» (кандидатские экзамены), «Основы информационных технологий» (диф. зачет), а также по дисциплинам профессиональной подготовки: «Основы педагогики и психологии высшей школы» (сдан зачет), «Эконометрическое моделирование и прогнозирование» (спецкурс).

3. Разработан план магистерской диссертационной работы

ВВЕДЕНИЕ

ГЛАВА 1. Методологические основы формирования портфеля

1.1. Обзор

1.2. Методы управления портфелем ценных бумаг

ГЛАВА 2. Формирование инвестиционного портфеля на основе адаптивных методов идентификации

2.1. Адаптивное оценивание риска при формировании портфеля ценных бумаг

2.2. Итеративные процедуры идентификации при оценке доходности портфеля

ГЛАВА 3. Применение адаптивных методов при анализе инвестиционного рынка ценных бумаг Российской Федерации

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

4. Опубликована статья: *Гедранович, О.Б. Методика формирования инвестиционного портфеля на основе промышленных индексов / О.Б. Гедранович // Интеллектуальные и инновационные технологии в управлении образованием НИЭУП'2007: материалы междунар. науч.-практ. конф., Невинномысск, 3 февраля 2007 г. / Невинномысский институт экономики, управления и права; редкол.: Т.Н. Рябченко [и др.]. – Невинномысск, 2007. – С. 425-429.*

Также были опубликованы тезисы по теме диссертации: *Гедранович, О.Б. Портфельная теория: нахождение баланса между риском и доходностью / О.Б. Гедранович // Человек, психология, экономика, право, управление: проблемы и перспективы: материалы IX междунар. науч. конф. Магистрантов и студентов, Минск, 13 мая 2006 г. / Минский институт управления; редкол.: Г.А. Хацкевич [и др.]. – Минск, 2006. – С. 380-382.*

5. Утверждено задание на выпускную работу по «Основам информационных технологий».
6. Произведены поиск и ознакомление с литературой, являющейся базовой для составления обзора по теме диссертации: 16 научных и учебных изданий, 3 автореферата, 10 электронных ресурсов (список прилагается).

Литература:

1. Алехин, Б.И. Рынок ценных бумаг: учеб. пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности 060400 «Финансы и кредит» / Б.И. Алехин. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2004. – 461 с.
2. Бригхэм, Ю. Финансовый менеджмент: теория и практика / Ю. Бригхэм, М. Эрхардт – 10-е изд. – СПб.: ПИТЕР, 2005. – 960 с.
3. Буренин, А.Н. Рынки производных финансовых инструментов / А.Н. Буренин. – М.: Инфра-М, 1996. – 386 с.
4. Гитман, Л. Дж. Основы инвестирования / Лоренс Дж. Гитман, Майкл Д. Джонк – М.: Дело, 1999. – 1008 с.
5. Ендовицкий, Д. Практикум по финансово-инвестиционному анализу. Ситуации. Методики. Решения / Д. Ендовицкий, Л. Коробейникова – М.: Кнорус, 2006. – 432 с.
6. Лукашин, Ю.П. Адаптивные методы краткосрочного прогнозирования временных рядов: учеб. пособие / Ю.П. Лукашин. – М.: Финансы и статистика, 2003. – 416 с.
7. Малюгин, В.И. Рынок ценных бумаг: Количественные методы анализа: учеб. пособие / В.И. Малюгин. – М.: Дело, 2003. – 320 с.
8. Медведев, Г.А. Практикум на ЭВМ по анализу временных рядов: учеб. пособие / Г.А. Медведев, В.А. Морозов. – Минск: Университетское, 2001. – 192 с.
9. Мертон, Р. Финансы.: пер. с англ.: учеб. пособие / Эви Боди, Роберт Мертон. – М.: Издательский дом «Вильямс», 2000. – 592 с.
10. Рынок ценных бумаг: учебник / редкол.: В.А. Галанов [и др.]. – 2-е изд., перераб. и доп. – М.: Финансы и статистика, 2004. – 448 с.
11. Саридис, Дж. Самоорганизующиеся стохастические системы управления / Дж. Саридис. – М.: Наука, 1980. – 400 с.
12. Себер, Дж. Линейный регрессионный анализ / Дж. Себер. – М.: Мир, 1980. – 456 с.
13. Толочко, Ю.М. Оптимизация выбора структуры финансовых инвестиций в иностранных валютах и драгоценных металлах: автореф. дис. ...канд. экон. наук: 08.00.13 / Ю.М. Толочко; БГЭУ – Минск., 2006. – 23 с.
14. Хацкевич, Г.А. Адаптивные процедуры оценивания параметров в задачах идентификации: автореф. дис. ...канд. техн. наук: 05.13.01 / Г.А. Хацкевич; ИТК АН БССР – Минск, 1982. – 18 с.
15. Хацкевич, Г.А. Эконометрическое моделирование и анализ неустойчивых процессов переходного периода: автореф. дис. ... докт. экон. наук: 08.00.13 / Г.А. Хацкевич; БГЭУ – Минск, 2001 – 40 с.
16. Хацкевич, Г.А. Селекция и управление портфелем ценных бумаг (современный эконометрический подход к оптимальному выбору структуры портфеля инвестиций). Практические рекомендации / Г.А. Хацкевич // Капитал-Эксперт. – 1996. – № 2(3). – С. 31-35; № 3(4). – С. 29-35; № 4(5). – С. 26-34.
17. Хацкевич, Г.А. Эконометрика: учебно-методический комплекс для студентов экономических специальностей / Г.А. Хацкевич, А.Б. Гедранович. – Минск: Изд-во МИУ, 2005. – 252 с.
18. Шведов, А.С. Теория эффективных портфелей ценных бумаг: Пособие для студентов, изучающих портфельную теорию и теорию финансовых деривативов / А.С. Шведов – М.: Изд-во ГУВШЭ, 1999. – 141 с.

19. Эйхгофф, П. Основы идентификации систем управления / П. Эйхгофф. – М.: Мир, 1975. – 686 с.
20. Bonds center. [Электрон. ресурс]. – 2006. – Режим доступа: http://finance.yahoo.com/bonds/composite_bond_rates
21. Инвестиционный портфель [Электрон. ресурс]. – 20 ноября 2005. – Режим доступа: <http://www.stockportal.ru/main/school/43>
22. Индексы Dow Jones. – 2003-2005, ОАО «ЮТРЭЙД.РУ». – <http://www.u-study.ru/>
23. Карпиков Е.И., Федоров А. Основные постулаты классической теории портфельных инвестиций. [Электрон. ресурс]. – 16 сентября 2005. – Режим доступа: <http://speculator-fin.ru/>
24. Лев Слущкин. Активный и пассивный портфельный менеджмент. [Электрон. ресурс]. – 1998. – Режим доступа: <http://speculator-fin.ru/>
25. Национальный банк Республики Беларусь: Методология составления статьи "Портфельные инвестиции" финансового счета Платежного баланса РБ [Электрон. ресурс]. – 2006. – Режим доступа: <http://www.nbrb.by/statistics/BalPayMethod/CapAccount/PortfolioInvest.asp>
26. Премия памяти Нобеля по экономике. [Электрон. ресурс]. – 2003. – Режим доступа: <http://www.n-t.ru/nl/ek/modigliani.htm>
27. Риски. Управление рисками. [Электрон. ресурс]. – 2004. – Режим доступа: http://www.cis2000.ru/publish/books/book_87/ch2_4.shtml
28. Спецификации контрактов. [Электрон. ресурс]. – 2006. – Режим доступа: <http://alpari-idc.ru/>
29. Формирование портфеля [Электрон. ресурс]. – 2006. – Режим доступа: <http://sekvestr-trade.narod.ru/portfolio/portfolio1.htm>

Во втором семестре (апрель-сентябрь 2007 г.) планируется:

1. Принять участие в работе X Международной научной конференции магистрантов и студентов «Человек, психология, экономика, право, управление: проблемы и перспективы» (19 мая 2007 г.)
2. Сдать кандидатские экзамены по дисциплинам «Философия и методология науки», «Английский язык» и зачет по «Основам информационных технологий».
3. Осуществить сбор и статистическую обработку данных инвестиционных рынков.
4. Подготовить материал для публикации одной статьи в научный журнал.

Научный руководитель:
д.э.н., профессор

Г.А. Хацкевич

Магистрант

О.Б. Гедранович