**Модуль:** «Проверка статистических гипотез»

Продолжительность: 8 академических часов

Преподаватель: Россохин Владимир Валерьевич, Кандидат экономических наук, специалист-практик по работе на финансовых рынках; анализ и оценка инвестиционных проектов – более 8 лет. Аттестованный специалист финансового рынка по брокерской, дилерской деятельности и деятельности по управлению ценными бумагами; аттестованный специалист финансового рынка ценных бумаг по управлению инвестиционными фондами, паевыми инвестиционными фондами и негосударственными пенсионными фондами. Доцент кафедры финансового менеджмента Факультета экономики НИУ ВШЭ.

Подтемы:

* Проверка гипотез: реальность или совпадение фактов?
* Цель проверки и интерпретация результатов.
* Гипотеза о равенстве среднего некоторому заданному значению.
* Сравнение двух выборок. Критерии различия. Параметрические и непараметрические подходы.

*Анонс:*

Цепь событий: жизнь меняется или так совпало?"  
Корректно ли работает ваш кофейный аппарат? Кладут ли должное количества мяса в банку с тушенкой? Есть ли эффект от рекламных мероприятий, существует ли дискриминация по гендерному признаку в сфере зарплат, хорошо ли лечит доктор, учит учитель и тренирует тренер? А средний чек вашего кафе действительно такой, как вы думаете? Все это можно оценить с помощью инструментария современной статистики. На курсе будут рассмотрены подходы к проверке базовых гипотез о сходстве и различии с использованием некоторых параметрических и непараметрических критериев.

|  |  |
| --- | --- |
| Дата | Время |
| 12.12 (вт) | 10.00 – 13.05 |
| 19.12 (вт) | 10.00 – 13.05 |

**Модуль:** «Оценка рисков инвестиционных проектов»

Продолжительность: 16 академических часов

Преподаватель: Россохин Владимир Валерьевич

*Анонс:*

Целью обучения является представление слушателям современных методов и механизмов анализа и оценки рисков  инвестиционных проектов – основных параметров, играющих ключевую роль при принятии инвестиционных решений.

Программа обучения включает следующие ключевые блоки:

|  |  |
| --- | --- |
| 1 | анализ чувствительности проекта |
| 2 | сценарный анализ |
| 3 | моделирование рисков методом Монте-Карло |
| 4 | управление рисками с помощью реальных опционов |
| 5 | оценка ставки дисконтирования при расчете NPV     - модель CAPM;     - метод долевой премии;     - кумулятивный метод;     - модель арбитражного ценообразования (обзорно);     - модель Фамы-Френча (обзорно) |
| 6 | Параметры инвестиционных проектов (NPV,PV, IRR) |

|  |  |
| --- | --- |
| Дата | Время |
| 28.11 (вт) | 10.00 – 13.05 |
| 29.11 (ср) | 10.00 – 13.05 |
| 5.12 (вт) | 10.00 – 13.05 |
| 6.12 (ср) | 10.00 – 13.05 |