



Universiteit van Pretoria Jaarboek 2018

Moderne portefeuljeteorie 712 (WTW 712)

Kwalifikasie	Nagraads
Fakulteit	Fakulteit Natuur- en Landbouwetenskappe
Modulekrediete	15.00
Programme	BScHons Finansiële Ingenieurswese
Voorvereistes	Registrasie word vir WTW 732 vereis
Kontaktyd	1 lesing per week
Onderrigtaal	Module word in Engels aangebied
Departement	Wiskunde en Toegepaste Wiskunde
Aanbiedingstydperk	Jaar

Module-inhoud

*Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

An introduction to Markowitz portfolio theory and the capital asset pricing model. Analysis of the deficiencies in these methods. *Hierdie inligting is slegs in Engels beskikbaar.

Sensitivity based risk management. Standard methods for Value-at-Risk calculations. RiskMetrics, delta-normal methods, Monte Carlo simulations, back and stress testing.

Die inligting wat hier verskyn, is onderhewig aan verandering en kan na die publikasie van hierdie inligting gewysig word.. Die [Algemene Regulasies \(G Regulasies\)](#) is op alle fakulteite van die Universiteit van Pretoria van toepassing. Dit word vereis dat elke student volkome vertrouwd met hierdie regulasies sowel as met die inligting vervat in die [Algemene Reëls](#) sal wees. Onkunde betreffende hierdie regulasies en reëls sal nie as 'n verskoning by oortreding daarvan aangebied kan word nie.