

Аннотация дисциплины

Управление портфелем финансовых активов

Рабочая программа дисциплины «Управление портфелем финансовых активов» предназначена для студентов, обучающихся по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, ОП "Экономика и финансы" (Финансы и инвестиции).

Цель дисциплины формирование у студентов, следующих компетенций:

ПКН-6 Способность предлагать решения профессиональных задач в меняющихся финансово-экономических условиях;

ПКП-4 способность исследовать современное состояние и выявлять тенденции развития финансового рынка, интерпретировать полученные данные для обеспечения эффективной деятельности экономических субъектов.

Место дисциплины в структуре ООП – дисциплина «Управление портфелем финансовых активов» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений, профиля и цикла профиля по направлению 38.03.01 Экономика, ОП "Экономика и финансы" (Финансы и инвестиции).

Краткое содержание:

Инвестиционный процесс и его этапы. Формирование инвестиционного портфеля по критериям ожидаемой доходности и риска. Построение оптимального портфеля. Модели оценки доходности финансовых активов. Однофакторные и многофакторные модели. Параметрические модели VAR и EaR. Стратегии управления инвестиционным портфелем. Оценка эффективности управления портфелем.