

Аннотация дисциплины

«Управление портфелем финансовых активов»

Цель дисциплины

- изучение методологических, теоретических и практических основ ценообразования формирование теоретической базы построения различных вариантов инвестиционных портфелей, включая все этапы от формализации постановки задачи до определения параметров модели и интерпретации полученных результатов.

Место дисциплины в структуре ОП

Дисциплина «Управление портфелем финансовых активов» входит в модуль дисциплин по выбору по направлению 38.03.01 «Экономика» (профиль «Корпоративные финансы»).

Краткое содержание дисциплины

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.