

Аннотация дисциплины

Управление портфелем финансовых активов

Цель дисциплины: 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» является дисциплиной вариативной части основной образовательной программы и входит в модуль дисциплин по выбору, углубляющих освоение профиля (Профильный блок дисциплин по выбору), по направлению 38.03.01 «Экономика» профиль «Финансовые рынки и банки».

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.