

Аннотация дисциплины

Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами

Рабочая программа дисциплины предназначена для студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» профиль «Корпоративные финансы».

Цель дисциплины: «Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами» формирование у студентов, обучающихся по направлению 38.04.01 «Экономика» профиль «Корпоративные финансы» следующих компетенций:

- способность обосновывать и принимать управленческие решения по оценке и управлению инвестиционными проектами, иметь знания и навыки в области разработки инвестиционной политики компании (ДКН-6);
- способность управлять экономическими рисками, инвестициями, финансовыми потоками на основе интеграции знаний из смежных областей, нести ответственность за принятые организационно-управленческие решения (ПКН-5).

Место дисциплины в структуре ООП - дисциплина «Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами» является дисциплиной части, формируемой участниками образовательных отношений, модуля дисциплин по выбору, углубляющих освоение программы магистратуры «Корпоративные финансы» направления 38.04.01 «Экономика».

Краткое содержание: Портфельные инвестиции корпорации. Использование модели Г.Марковица при оптимизации портфеля инвестиций. Ценообразование на рынке капитала. Модель CAPM. Теория арбитражной оценки. Модели оценки опционов и их применение в корпоративных решениях. Модель Блэка – Шоулза. Управление портфелем инвестиций корпорации.