

Аннотация дисциплины «Альтернативные инвестиции»

Цель дисциплины: формирование у студентов системы знаний, аналитических и практических навыков анализа и отбора альтернативных инвестиционных стратегий в портфель инвестора, в том числе в сравнении с традиционными инвестиционными продуктами. В процессе обучения внимание слушателей фокусируется на фундаментальных характеристиках доходности и риска традиционных инвестиционных стратегий, сравнительном анализе типовых стратегий хедж-фондов, методах оценки и минимизации риска портфеля при включении в него альтернативных инвестиционных продуктов

Место дисциплины в структуре ООП: относится к дисциплинам цикла профиля учебного плана основной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.02 Менеджмент образовательная программа «Финансовый менеджмент».

Краткое содержание. Распределение активов в инвестиционном портфеле. Сравнение активного и индексного фондов в долгосрочном периоде. Основы активного управления инвестиционным портфелем. Базовые характеристики риска и доходности инвестиционных стратегий: tracking error, information ratio. Широта инвестиционной стратегии. . Бенчмарки для альтернативных инвестиционных стратегий. Введение в хедж-фонды: историческая справка, объем индустрии. Категории хеджфондов. Основные стратегии хедж-фондов, динамика доходности в сравнении с основными классами активов. Риск-менеджмент хедж-фондов. Индексы хедж-фондов. Структура комиссионных вознаграждений за управление в хедж-фондах.