

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.

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.