

Аннотация дисциплины

Инвестиционный портфель корпораций: оценка, источники финансирования, управление.

Цель дисциплины:

формирование у студентов по управлению портфелем ценных бумаг, и моделям оценки финансовых активов.

Краткое содержание:

Модель Марковица оптимального портфеля. Модели финансовых временных рядов. Вероятностная микроструктура динамики биржевых цен. Понятие волатильности. Моделирование логарифмической доходности. Анализ волатильности на основе разделения нормальных смесей.