

Управління інвестиційним портфелем

Викладач: Черненко Катерина
Петрівна, к.е.н., доцент,
зав. кафедри фінансів і
кредиту, каб.10-326, e-mail:
k.chernenok@gmail.com

Мета дисципліни - формування у здобувачів освітньо-наукового рівня вищої освіти системного та поглибленого розуміння теоретичних, методологічних і прикладних засад управління інвестиційним портфелем, розвиток вміння обґрунтовувати інвестиційні рішення на основі сучасних моделей оцінювання дохідності та ризику, здійснювати портфельну оптимізацію, враховувати макроекономічні, ринкові, поведінкові, ESG та геополітичні чинники, а також застосовувати відповідний інструментарій у наукових дослідженнях.

Очікуваний результат: здобувачі вмітимуть застосовувати сучасні теоретичні та методологічні підходи до формування, оптимізації й управління інвестиційним портфелем, оцінювати його дохідність, ризики та ефективність з урахуванням макроекономічних, ринкових, поведінкових та ESG-факторів, а також здійснювати науково обґрунтований аналіз інвестиційних стратегій, використовувати сучасні статистичні та економетричні методи дослідження та формулювати рекомендації щодо управління портфелем в умовах невизначеності та структурних змін фінансових ринків.

Сутність курсу розкривається у таких темах:

Тема 1. Теоретичні засади та сучасні концепції управління інвестиційним портфелем

Тема 2. Інвестиційні активи та оцінювання їхньої дохідності й ризику

Тема 3. Моделі формування та оптимізації інвестиційного портфеля

Тема 4. Управління ризиками інвестиційного портфеля

Тема 5. Стратегії управління інвестиційним портфелем та оцінювання результативності

Тема 6. Поведінкові та макроекономічні чинники управління портфелем

Тема 7. ESG-інвестування та сучасні напрями розвитку портфельного менеджменту

Тема 8. Науково-прикладні підходи до управління інвестиційним портфелем в умовах невизначеності

Управління інвестиційним портфелем

Оцінювання:

Залік – 30 балів

Робота за семестр – 70 балів:

аналітична робота – 20 балів

участь у дискусіях під час групових занять – 6×5 балів = 30 балів

участь у виконанні розрахункових завдань, кейсів під час групових занять – 2×10 балів = 20 балів

Технічні вимоги: Wi-Fi чи мобільний інтернет; гаджет, що дозволяє працювати з сайтами фондових та товарних бірж; використання Excel, PowerPoint

Академічна доброчесність: передбачає самостійне виконання аналітичної та розрахункових робіт; у разі наявності текстових збігів, копіювання, списування або фальсифікації даних робота не зараховується

Консультування з дисципліни надається згідно графіку консультування кафедри фінансів і кредиту, каб.10-326.

Вимоги до робіт:

1. Аналітична робота передбачає здійснення оптимізації інвестиційного портфелю акцій: котирування акцій не менш ніж 5 компаній, діапазон дослідження – не менше 1 року, щомісячні ціни закриття. Необхідно визначити питому вагу окремих цінних паперів в портфелі (визначення мінімального рівня дохідності та максимального рівня допустимого ризику).

2. Дискусії, розрахункові завдання, кейси проводяться в малих групах під час групових занять за їх тематикою.