

Název modulu: Portfolio management

Kód modulu: POMA

Garant modulu: Ing. Aleš Tůma

Lektoři modulu: Ing. Aleš Tůma, Ing. Oldřich Šoba, Ph.D.,
Ing. Petr Šimčák, CFA, Pavel Kohout

Cíl modulu:

Modul Portfolio management se zaměřuje na problematiku optimálního rozložení zdrojů z pohledu teorie portfolia. Součástí je i problematika oceňování kapitálových aktiv na základě metod odvozených od teorie portfolia. Jednotlivé přístupy a modely sestavování, analýzy a hodnocení portfolia jsou prezentovány na konkrétních početních příkladech. Nedílnou součástí je i měření výkonnosti portfolia a jeho komparace se zvoleným benchmarkem.

Počet hodin přímé výuky: 8

Počet hodin webcastů: 4

Obsah modulu:

A) Úvod do teorie portfolia

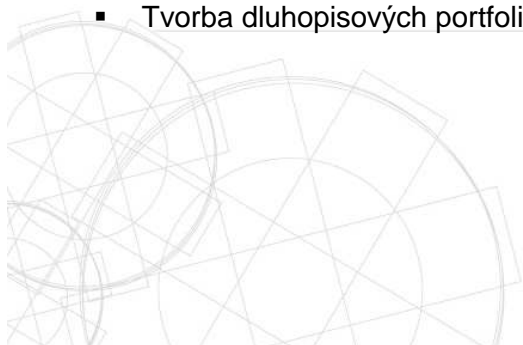
- Význam portfolio managementu a základní pojmy
- Teorie portfolio managementu
- Model CAPM
- Model APT

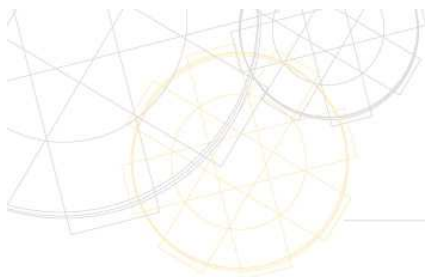
B) Akciová portfolia

- Tvorba akciových portfolií
- Oceňování akciových portfolií
- Výkonnost a rizikovost akciových portfolií

C) Dluhopisová portfolia

- Tvorba dluhopisových portfolií





- Oceňování dluhopisových portfolií
- Výkonnost a rizikovost dluhopisových portfolií

D) Smíšená portfolia (webcast)

- Tvorba smíšených portfolií
- Oceňování smíšených portfolií
- Výkonnost a rizikovost smíšených portfolií

E) Deriváty v portfolio managementu (webcast)

- Derivátová portfolia
- Využití derivátů v portfolio managementu

F) Využití portfolio managementu v praxi (webcast)

Základní zdroje:

- Kohout, P. Investiční strategie pro třetí tisíciletí. 6. přepracované vydání. Praha: Grada Publishing, 2010.
- Studijní materiály modulu Portfolio management; k dispozici ve studijním IS.
- Podkladové materiály modulu k přímé výuce a webcastům; k dispozici ve studijním IS.

