

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

**ГОСУДАРСТВЕННЫЙ ИНСТИТУТ УПРАВЛЕНИЯ
И СОЦИАЛЬНЫХ ТЕХНОЛОГИЙ**

Кафедра управления финансами

МЕХАННИКОВА
Екатерина Сергеевна

ОПТИМИЗАЦИЯ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ ОРГАНИЗАЦИИ

Дипломная работа

Научный руководитель:
кандидат экономических наук,
доцент И.И. Краснова

Допущена к защите

« ___ » _____ 2017 г.

Зав. кафедрой управления финансами

_____ М.Л. Зеленкевич

кандидат экономических наук, доцент

Минск, 2017

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 67 с., 3 рис., 16 табл., 43 источника, 4 приложения.

Ключевые слова: ПОРТФЕЛЬНЫЕ ИНВЕСТИЦИИ, АКЦИИ, ОБЛИГАЦИИ, ФИНАНСОВЫЕ ВЛОЖЕНИЯ, ЦЕННЫЕ БУМАГИ, РИСК, ДОХОДНОСТЬ

Объект исследования – СП «Санта Бремор» ООО.

Предмет исследования – методы формирования и оптимизации инвестиционного портфеля анализируемой компании.

Цель работы – изучение теоретических и практических основ формирования оптимальной структуры портфеля ценных бумаг на примере СП «Санта Бремор» ООО.

В процессе работы изучены понятие, экономическая сущность и классификация инвестиций, особенности портфельного инвестирования; исследованы типы инвестиционных портфелей и особенности управления ими; рассмотрены основные существующие методы оптимизации инвестиционного портфеля. Также проанализированы тип инвестиционного портфеля компании, его состав, объем и структура; определены направления совершенствования структуры портфеля инвестиций в соответствии с выбранным его типом и политикой компании; сформирован оптимальный портфель ценных бумаг.

Областью возможного практического применения являются рекомендации по совершенствованию портфельного инвестирования в СП «Санта Бремор» ООО.

Автор работы подтверждает, что приведенный в ней аналитический и расчетный материал правильно и объективно отражает состояние исследуемого вопроса, а все заимствованные из литературных и других источников, теоретические и методологические положения и концепции сопровождаются ссылками на их авторов.

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца: 67 с., 3 мал., 16 табл., 43 крыніцы, 4 прыкладання.

Ключавыя словы: ПАРТФЕЛЬНЫЯ ІНВЕСТЫЦЫІ, АКЦЫІ, АБЛІГАЦЫІ, ФІНАНСАВЫХ УКЛАДАННЯЎ, КАШТОЎНЫЯ ПАПЕРЫ, РЫЗЫКА, ДАХОДНАЯ

Аб'ект даследавання – СП "Санта Брэмар" ТАА.

Прадмет даследавання – метады фарміравання і аптымізацыі інвестыцыйнага партфеля аналізаванай кампаніі.

Мэта работы – вывучэнне тэарэтычных і практычных асноў фарміравання аптымальнай структуры партфеля каштоўных папер на прыкладзе СП "Санта Брэмар" ТАА.

У працэсе працы вывучаны паняцце, эканамічную сутнасць і класіфікацыю інвестыцый, асаблівасці партфельнага інвеставання; даследаваны тыпы інвестыцыйных партфеляў і асаблівасці кіравання імі; разгледжаны асноўныя існуючыя метады аптымізацыі інвестыцыйнага партфеля. Таксама прааналізаваны тып інвестыцыйнага партфеля кампаніі, яго склад, аб'ём і структуру; вызначаны напрамкі ўдасканалення структуры партфеля інвестыцый у адпаведнасці з абраным яго тыпам і палітыкай кампаніі; сфарміраваны аптымальны партфель каштоўных папер.

Вобласцю магчымага практычнага прымянення з'яўляюцца рэкамендацыі па ўдасканаленні партфельнага інвеставання ў СП «Санта Брэмар» ТАА.

Аўтар працы пацвярджае, што прыведзены ў ёй аналітычны і разліковы матэрыял правільна і аб'ектыўна адлюстроўвае стан доследнага пытання, а ўсе запазычаныя з літаратурных і іншых крыніц, тэарэтычныя і метадалагічныя палажэнні і канцэпцыі суправаджаюцца спасылкамі на іх аўтараў.

ABSTRACT

Thesis work: 67 pp., 3 images, 16 tables, 43 sources, 4 applications.

Keywords: PORTFOLIO INVESTMENTS, SHARES, BONDS, FINANCIAL INVESTMENTS, SECURITIES, RISK, YIELD

The object of the research is JV Santa Bremor LLC.

The subject of the research is methods of formation and optimization of the investment portfolio of the analyzed company.

The aim of the work is to study the theoretical and practical foundations for the formation of the optimal structure of the securities portfolio by the example of Santa Bremor LLC.

In the process of work, the concept, economic essence and classification of investments, features of portfolio investment, are studied; The types of investment portfolios and the features of their management; The main existing methods of optimizing the investment portfolio are considered. The type of investment portfolio of the company, its composition, volume and structure were also analyzed; Directions for improving the structure of the investment portfolio in accordance with the chosen type and policy of the company; An optimal portfolio of securities was formed.

The area of possible practical application is recommendations for improving portfolio investment in JV "Santa Bremor" LLC.

The author of the paper confirms that the analytical and calculation material presented in it correctly and objectively reflects the state of the issue under investigation, and all borrowed from literary and other sources, theoretical and methodological positions and concepts are accompanied by references to their authors.