

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ РЕСПУБЛИКИ БЕЛАРУСЬ

БЕЛОРУССКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ

ФАКУЛЬТЕТ МЕЖДУНАРОДНЫХ ОТНОШЕНИЙ

Кафедра международных экономических отношений

КОНОНОВ

Матвей Владимирович

**СОВРЕМЕННЫЕ СТРАТЕГИИ УПРАВЛЕНИЯ ИНВЕСТИЦИОННЫМ
ПОРТФЕЛЕМ НА МЕЖДУНАРОДНОМ РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ**

Аннотация дипломной работы

Научный руководитель -
кандидат экономических наук,
доцент О.Ч. Кирвель

Допущена к защите

«__» _____ 2024 г.

Зав. кафедрой международных экономических отношений

кандидат экономических наук, доцент Н.В. Юрова

Минск, 2024

РЕФЕРАТ

Дипломная работа: 69 с., 10 рис., 11 табл., 45 источника, 8 прил.

Ключевые слова: ИНВЕСТИЦИОННЫЙ ПОРТФЕЛЬ, ПОРТФЕЛЬНОЕ ИНВЕСТИРОВАНИЕ, МЕЖДУНАРОДНЫЙ РЫНОК ЦЕННЫХ БУМАГ, ПОРТФЕЛЬНАЯ ТЕОРИЯ, РИСК, ДОХОДНОСТЬ

Объект исследования: современные портфельные теории, портфельное инвестирование

Цель исследования: исследование основных современных стратегий формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг и выявление их эффективности в рамках современных экономических тенденций.

Методы исследования: стандартное отклонение, коэффициент Шарпа, корреляционная матрица, ковариационная матрица, эффективная линия Марковица, средняя доходность, теоретический анализ, сравнительный анализ, статистический анализ, моделирование.

Полученные результаты и их новизна: в результате исследования были выявлены основные принципы формирования инвестиционного портфеля ценных бумаг, подвержены сравнению различные портфельные стратегии, обнаружены основные проблемы и риски, связанные с портфельным инвестированием, а также предложены пути их решения.

Область возможного практического применения: результаты исследования можно применить в контексте развития портфельного инвестирования в Республике Беларусь, также возможно применение методов исследования в отношении оценки портфелей инвесторов различных стран.

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

(подпись студента)

РЭФЕРАТ

Дыпломная праца: 69 с., 10 мал., 11 табл., 45 крыніц, 8 прыкл.

Ключавыя словы: ІНВЕСТЫЦЫЙНЫ ПАРТФЕЛЬ, ПАРТФЕЛЬНЫЯ ІНВЕСТАВАННЕ, МІЖНАРОДНЫ РЫНАК КАШТОЎНЫХ ПАПЕР, ПАРТФЕЛЬНЫХ ТЭОРЫЯ, РЫЗЫКА, ДАХОДНАСЦЬ

Аб'ект даследавання: сучасныя партфельныя тэорыі, партфельныя інвеставанне

Мэта даследавання: даследаванне асноўных сучасных стратэгіі фарміравання інвестыцыйнага партфеля каштоўных папер і выяўленне іх эфектыўнасці ў рамках сучасных эканамічных тэндэнцый.

Метады даследавання: стандартнае адхіленне, каэфіцыент Шарпа, карэляцыйныя матрыца, коваріацыйная матрыца, эфектыўная лінія Марковица, сярэдняя прыбытковасць, Тэарэтычны аналіз, параўнальны аналіз, статыстычны аналіз, мадэляванне.

Атрыманыя вынікі і іх навізна: у выніку даследавання былі выяўлены асноўныя прынцыпы фарміравання інвестыцыйнага партфеля каштоўных папер, схільныя параўнанні розных партфельных стратэгіі, выяўленыя асноўныя праблемы і рызыкі, звязаныя з партфельных інвеставаннем, а таксама прапанаваны шляхі іх вырашэння.

Вобласць магчымага практычнага прымянення: вынікі даследавання можна ўжыць у кантэксце развіцця партфельнага інвеставання ў Рэспубліцы Беларусь, таксама магчыма прымяненне метадаў даследавання ў дачыненні да ацэнкі партфеляў інвестараў розных краін.

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

(подпіс студента)

ANNOTATION

Degree paper: 69 p., 10 ill., 13 tab., 45 sources, 8 app.

Key words: INVESTMENT PORTFOLIO, PORTFOLIO INVESTMENT, INTERNATIONAL SECURITIES MARKET, PORTFOLIO THEORY, RISK, PROFITABILITY

Object of research: modern portfolio theories, portfolio investment

Purpose of research: the study of the main modern strategies for the formation of an investment portfolio of securities and the identification of their effectiveness within the framework of modern economic trends.

Research methods: standard deviation, Sharpe coefficient, correlation matrix, covariance matrix, effective Markowitz line, average return, theoretical analysis, comparative analysis, statistical analysis, modeling.

The results obtained and their novelty: As a result of the study, the basic principles of forming an investment portfolio of securities were identified, various portfolio strategies were compared, the main problems and risks associated with portfolio investment were discovered, and ways to solve them were proposed.

Area of possible practical application: The results of the study can be applied in the context of the development of portfolio investment in the Republic of Belarus, it is also possible to apply research methods in relation to the assessment of portfolios of investors from different countries.

The author of the work confirms that the computational and analytical material presented in it correctly and objectively reflects the state of the process under study, and all theoretical, methodological and methodological provisions and concepts borrowed from literary and other sources are accompanied by references to their authors.

(student's signature)