

ડૉ. બાબાસાહેબ આંબેડકર ઓપન યુનિવર્સિટી  
સ્કૂલ ઓફ કોમર્સ એન્ડ મેનેજમેન્ટ  
**Third Semester M.Com. (Elective Course)**  
**પોર્ટફોલિયો સંચાલન (Portfolio Management)**

યુનિટ	વિષયવસ્તુના મુદ્દા
1.	પોર્ટફોલિયો સંચાલન
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- મહત્વ</li> <li>- ઉદ્દેશો અને પોર્ટફોલિયો રચના અંગેની વિવિધ બાબતો</li> <li>- પોર્ટફોલિયોનું પુનરાવર્તન અને મૂલ્યાંકન</li> <li>- પોર્ટફોલિયો સંચાલનનું કાર્યક્ષેત્ર</li> </ul>
2.	પોર્ટફોલિયો વિશ્લેષણ
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- અંદાજીત વળતરનો દર</li> <li>- પોર્ટફોલિયો વળતરનું પ્રમાણિત વિચલન</li> <li>- માર્કાવિટ્ઝનો જોખમ અને વળતર શ્રેષ્ઠ ઉપયોગનો સિદ્ધાંત</li> <li>- એકલ (વ્યક્તિગત) ઇન્ડેક્સ મોડેલ</li> <li>- પોર્ટફોલિયો કુલ (સંપૂર્ણ) જોખમ મોડેલ</li> <li>- પોર્ટફોલિયો બજાર જોખમ અને અનન્ય જોખમ</li> <li>- તીવ્રતાનો મહત્તમ (ઇન્ડેક્સ) ઉકેલ</li> </ul>
3.	મૂડી બજાર સિદ્ધાંત
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- મૂડી બજાર શ્રેણી</li> <li>- જામીનગીરી બજાર શ્રેણી</li> <li>- જોખમ રહિત ધિરાણ અને ઋણ</li> <li>- પરિબળો મોડેલ</li> <li>- આર્બિટ્રેજ ભાવનો સિદ્ધાંત</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>- બે પરિબળો અને બહુ પરિબળ મોડેલ</li> <li>- મુખ્ય આર્બિટ્રેજ પોર્ટફોલિયો</li> </ul>
4.	કાર્યક્ષમ બજાર પૂર્વધારણાઓ
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- ધારણાઓ</li> <li>- નબળાઈ</li> <li>- અર્ધ-મજબૂત</li> <li>- મજબૂત બજાર અને તેની પરીક્ષણ તકનીકો</li> </ul>
5.	પોર્ટફોલિયો કામગીરી મૂલ્યાંકન
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પોર્ટફોલિયો બનાવવાની પદ્ધતિઓ</li> <li>- વળતરનું માપન</li> <li>- કામગીરી મૂલ્યાંકનનાં સુધારેલ જોખમ પગલાંઓ</li> <li>- બજાર સમયગણના</li> <li>- મૂલ્યાંકન માપદંડો અને પ્રક્રિયાઓ</li> </ul>
6.	પોર્ટફોલિયો બનાવવાની પ્રક્રિયા
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- બેચમાર્ક પોર્ટફોલિયો</li> <li>- બેચમાર્ક પોર્ટફોલિયોની જરૂરી લાક્ષણિકતાઓ</li> <li>- બેચમાર્ક પોર્ટફોલિયોની ઉપયોગિતા</li> <li>- બજાર અનુક્રમણિકા પોર્ટફોલિયો</li> <li>સીએનએક્સ નિફ્ટી ઇન્ડેક્સ પોર્ટફોલિયો પસંદગી પ્રક્રિયા</li> <li>- પોર્ટફોલિયો બનાવવા માટેના અભિગમો <ul style="list-style-type: none"> <li>o વૃદ્ધિ રોકાણ</li> <li>o કીમત રોકાણ</li> <li>o વૈવિધ્યસભર પોર્ટફોલિયો બનાવવા</li> </ul> </li> <li>- બોન્ડ પોર્ટફોલિયો બનાવવા</li> <li>બોન્ડ પોર્ટફોલિયો ઉદ્દેશો અને શૈલી</li> <li>- ઇક્વિટી પોર્ટફોલિયો બનાવવા</li> <li>- મિશ્રિત પોર્ટફોલિયો બનાવવા</li> <li>- આંતરરાષ્ટ્રીય પોર્ટફોલિયો બનાવવા</li> </ul>
7.	બોન્ડનું વિશ્લેષણ
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> </ul>

	<ul style="list-style-type: none"> <li>- વ્યાખ્યા</li> <li>- માળખું</li> <li>- પદ્ધતિઓ</li> <li>- જથ્થા વિશ્લેષણ (Quantitative)</li> <li>- ગુણવત્તા વિશ્લેષણ (Qualitative)</li> <li>- બજારના વ્યાજદરનું વિશ્લેષણ</li> <li>- બોન્ડનું મૂલ્યાંકન</li> <li>- બોન્ડમાં રોકાણની વ્યૂહરચનાઓ</li> <li>- બોન્ડમાં રોકાણના નિર્ણયો</li> </ul>
8.	પોર્ટફોલિયોમાં રોકાણની થીયરી
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- પોર્ટફોલિયો થીયરી :</li> <li>- અંદાજીત જોખમ અને વળતરનો દર</li> <li>- MW સિક્કાંત</li> <li>- વિલિયમ શાર્પ ઇન્ડેક્સ મોડેલ</li> <li>- માર્કોવિત્ઝ થીયરી</li> </ul>
9.	પોર્ટફોલિયોની મોડર્ન થીયરી
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- CAPM મોડેલ</li> <li>- આર્બિટ્રેજ ભાવની થીયરી</li> </ul>
10.	પોર્ટફોલિયો સંચાલનની પ્રક્રિયા
	<ul style="list-style-type: none"> <li>- પ્રસ્તાવના</li> <li>- અર્થ</li> <li>- પરંપરાગત પોર્ટફોલિયો સંચાલનની પ્રક્રિયા</li> <li>- હેતુઓ</li> <li>- પોર્ટફોલિયો સંચાલન</li> </ul>