

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ Б1.В.09 «ОЦЕНКА ЭФФЕКТИВНОСТИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ»

**Для подготовки бакалавров по направлению 38.03.01 «Экономика»
(профиль «Финансы и кредит»)
(Аннотация)**

Цели освоения дисциплины: дать обучающимся систематизированные знания по актуальным теоретическим и практическим вопросам проведения оценки эффективности инвестиционного портфеля, сформировать профессиональные представления в области портфельного инвестирования, приобрести умения и навыки проведения оценки экономических процессов и явлений в целях формирования эффективного инвестиционного портфеля.

Компетенции студента, формируемые в результате освоения дисциплины

В результате освоения дисциплины формируются следующие компетенции: ПК-22.

Ожидаемые результаты

В результате изучения курса студент должен:

Знать:

- законодательные и нормативные акты, регулирующие формирование инвестиционного портфеля ПК-22-31;
- типы портфелей в зависимости от цели и задач инвестора ПК-22- 32;
- методологию формирования инвестиционного портфеля ПК-22-33;
- отечественный и зарубежный опыт оценки экономической эффективности инвестиционного портфеля ПК-22-34;
- основные методы оценки эффективности инвестиционного портфеля ПК-22-35;
- источники финансирования инвестиционного портфеля ПК-22-36;
- основные направления и последовательность выполнения процедур инвестиционного анализа ПК-22-37;
- особенности анализа портфеля ПК-22-38;
- основные методы предотвращения и снижения рисков инвестиционного портфеля ПК-22-39;
- нормы, регулирующие учет и контроль при формировании инвестиционного портфеля ПК-22-310.

Уметь:

- применять на практике законодательные и нормативные акты, регулирующие формирование инвестиционного портфеля ПК-22-У1;
- анализировать типы портфелей в зависимости от цели и задач инвестора ПК-22-У2;
- осуществлять отбор ценных бумаг и производных финансовых инструментов ПК-22-У3;
- обосновывать и представлять методологию формирования инвестиционного портфеля ПК-22-У4;
- применять методы оценки эффективности инвестиционного портфеля ПК-22-У5;
- определять эффективные источники финансирования инвестиционного портфеля ПК-22-У6;
- применять основные направления и последовательность выполнения процедур инвестиционного анализа ПК-22-У7;
- обосновывать результаты анализа портфеля ПК-22-У8;
- применять основные методы предотвращения и снижения рисков инвестиционного портфеля ПК-22-У9;
- формировать нормы, регулирующие учет и контроль при формировании инвестиционного портфеля ПК-22-У10.

Владеть:

- навыками применения на практике законодательных и нормативных актов, регулирующих формирование инвестиционного портфеля ПК-22-В1;
- навыками по подбору эффективных инструментов инвестирования ПК-22-В2;

- различными приемами и принципами оценки финансовых инструментов ПК-22-В3;
- механизмами моделирования инвестиционных портфелей ПК-22-В4;
- методами оценки эффективности инвестиционного портфеля ПК-22-В5;
- традиционными критериями выбора альтернативных инвестиционных портфелей ПК-22-В6;
- навыками согласования решений в области портфельного инвестирования ПК-22-В7
- алгоритмом оценки и управления рисками инвестиционного портфеля ПК-22-В8;
- навыками анализа итоговых показателей сформированного портфеля инвестиций ПК-22-В9
- способами взаимоотношений, с органами, регулирующими учет и контроль при формировании инвестиционного портфеля ПК-22-В10.

Содержание дисциплины:

Основы формирования инвестиционного портфеля. Оценка эффективности финансовых инвестиций. Источники, формы и методы финансирования инвестиционного портфеля. Инвестирование в нефинансовые инструменты. Инвестиционный портфель долевых и долговых ценных бумаг и его оптимизация. Инвестиционные возможности с использованием производных финансовых инструментов. Оценка эффективности инвестиционного портфеля. Учет фактора риска и неопределенности портфельного инвестирования.