**Аннотация дисциплины**

**Управление портфелем финансовых активов**

Рабочая программа дисциплины предназначена для студентов, обучающихся по направлению 38.03.01 «Экономика» профиль «Анализ рисков и экономическая безопасность»

**Цель дисциплины:**

- формирование теоретической базы построения различных вариантов инвестиционных портфелей, включая все этапы от формализации постановки задачи до определения параметров модели и интерпретации полученных результатов.

**Место дисциплины в структуре ООП:**

Дисциплина цикла профиля (элективный) модуля 6 «Операции на финансовых и товарно-сырьевых рынках» основной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.01 Экономика, профиль «Анализ рисков и экономическая безопасность»

**Краткое содержание:**

Инвестиционный процесс и его этапы. Формирование инвестиционного портфеля по критериям ожидаемой доходности и риска. Построение оптимального портфеля. Модели оценки доходности финансовых активов. Однофакторные и многофакторные модели. Параметрические модели VAR и ЕаR. Стратегии управления инвестиционным портфелем. Оценка эффективности управления портфелем.