



## Инвестиционное управление и анализ (KFJ-015)

(Investeeringute juhtimine ja -analüüs)

(Investment management and analysis)

### AINEKAART

<b>Объем предмета (EAP)</b>	5.00 ECTS
<b>Оценивание</b>	eristav hindamine
<b>Цель курса и краткое описание</b>	
<p>В рамках курса изучаются следующие темы: Понятия инвестиции и сбережения, реальные и финансовые инвестиции, финансовые рынки и их типы. Акции, облигации, производные финансовые инструменты (опционы, фьючерсы, форварды, свопы) и прочие инвестиционные возможности. Важнейшие понятия, связанные с ценными бумагами. Концепция временной ценности денег и ценных бумаг, оценка их доходности, текущей и будущей стоимости, аннуитет и перпетуитет. Инвестиционные риски, систематический и специфический риски, основы портфельной теории, рыночная модель (САРМ). Составление инвестиционного портфеля и принципы управления. Инвестиционные фонды. Инвестиционный счёт. Фундаментальный анализ предприятия и оценка стоимости акции. Методы оценки стоимости. Технический анализ на финансовых рынках, индикаторы технического анализа. Оценка реальных инвестиций предприятия. Приростные (дополнительные) денежные потоки и составление бюджета инвестиционного проекта. Показатели, используемые для оценки эффективности проектов – срок рентабельности, NPV, IRR, эквивалентный аннуитет. Дополнительные возможности оценки инвестиционных рисков (анализ рентабельности, анализ сценариев, анализ чувствительности)</p>	
<b>Результаты обучения:</b>	
Студент:	
<ol style="list-style-type: none"><li>1. Знает различные классы собственности и возможности их использования;</li><li>2. Умеет рассчитывать рентабельность предприятия исходя из контекста.</li></ol>	