

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/kursovaya-rabota/187825>

Тип работы: Курсовая работа

Предмет: Финансовый менеджмент

Введение 3

Глава 1. Теоретические основы формирования инвестиционного портфеля и оценка риска его доходности 5

1.1 Понятие и типы инвестиционного портфеля 5

1.2 Этапы формирования инвестиционного портфеля 8

1.3 Цель формирования портфеля ценных бумаг 10

Глава 2. Анализ и прогнозирование рисков при вложении капитала в ценные бумаги на примере ЗАО «Сургутнефтегазбанк» 15

2.1. Оценка эффективности управления портфелем 15

2.2. Оценка рисков при вложении капитала в ценные бумаги 22

Глава 3. Проблемы выбора ценных бумаг для инвестирования 31

Заключение 35

Список использованной литературы 37

Введение

В соответствии с концепцией развития финансового рынка, неотъемлемой составляющей анализа инвестиционной привлекательности акционерного общества является исследование риска инвестирования в его ценные бумаги. Необходимость изучения риска обусловлена тем, что доход от инвестиций в ценные бумаги может быть меньше ожидаемого или вообще не может быть получен. Кроме того, инвестор может потерять часть капитала, вложенного в бизнес или весь капитал. Таким образом, анализ риска должен быть связан с пониманием того, что может случиться и что должно случиться, и представляет собой множество подходов, связанных с оценкой, контролем и управлением рисками.

Процесс формирования инвестиционного портфеля связан с подбором определенной совокупности объектов инвестирования для осуществления инвестиционной деятельности. Современная портфельная теория исходит из того, что при осуществлении инвестиционной деятельности инвесторы могут вкладывать средства не в один, а несколько объектов, формируя тем самым некую совокупность объектов инвестирования. При этом возникает задача подбора объектов инвестирования в соответствии с заданными предпочтениями.

Сущность портфельного инвестирования заключается в распределении инвестиционного потенциала между разными группами активов. Портфельное инвестирование позволяет планировать и контролировать результаты инвестиционной деятельности. Обычно портфель представляет собой набор из корпоративных акций, облигаций с различной степенью риска, ценных бумаг с фиксированным доходом, гарантированным государством, а значит, с минимальным риском потерь вложенных средств и получения дохода.

В данной работе комплексно изложены теоретические, практические и организационные вопросы касающиеся анализа и прогнозирования рисков при вложении капитала в ценные бумаги. Здесь отражено понятие инвестиционного портфеля и его виды, рассмотрена оценка эффективности управления инвестиционным портфелем, а также выполнен практический пример условно сформированного инвестиционного портфеля на российском фондовом рынке.

Цель работы: провести анализ и прогнозирование рисков при вложении капитала в ценные бумаги.

Объект работы: ценные бумаги, инвестиционный портфель.

Предмет работы: формирование инвестиционного портфеля.

Задачи работы следующие:

- изучить теоретические основы формирования инвестиционного портфеля;
- провести анализ и прогнозирование рисков при вложении капитала в ценные бумаги;
- рассмотреть проблемы выбора ценных бумаг для инвестирования.

Работа состоит из введения, трех глав, заключения и списка использованной литературы.

1. Анализ особенностей модернизации производственных мощностей предприятия авиационной промышленности. Вестник Московского Авиационного Института, 22 (4), 208-212. Москвичева Н.В., Бурко М.Л., Соколова А.А., 2020.
2. Анализ методического обеспечения технико-экономического обоснования инвестиционных проектов в авиационной промышленности. Материалы 15-й Международной научно-практической конференции, Санкт-Петербург, с. 148-155. Никулина, Е.Н. и Тарасова Е.В., 2016.
3. Бурдина А.А. и Соловьева И.В. Анализ методов анализа финансовых рисков предприятий авиационной отрасли. Экономика и предпринимательство, 12-1 (41-1), 659-662. 2020.
4. Вопросы оценки предприятий авиационной промышленности. Монография, Москва, МАИ-ПРИНТ, 204 с. Москвичева Н.В., Трошин А.Н., Фомкина В.И., 2019.
5. Вопросы экономического обоснования процессов реорганизации предприятий авиационной промышленности. Монография, Москва: МАИ Принт. Недосекин А.О., 2017.
6. Грачева М.В. и Ляпина С.Ю., Управление рисками в инновационной деятельности. Учебное пособие, Москва, ЮНИТИ, 2019. 350 с.
7. Методика оценки эффективности модернизации испытательных подразделений по производству летальных аппаратов. Вестник Московского государственного технологического университета «Станкин» (МГТУ Станкин), 1 (36), 91-95. Никулина Е.Н., Тарасова Е.В., Трошин А.Н., Фомкина В.И., 2020.
8. Механизм анализа экономической надежности инновационного потенциала авиационных предприятий. Международный журнал прикладных деловых и экономических исследований, 14, 747-765.2019
9. Методологические основы моделирования финансовой деятельности с использованием нечетко-множительных описаний. Докторская диссертация по экономике. Санкт-Петербургский университет экономики и финансов, Санкт-Петербург, 280 с. Николаев, Ю.В., 2020.
10. Оценка бизнеса. Учебное пособие и тематические исследования. М. : Юрай, 299 с. Трошин А.Н. Бурдина А.А., Разжевайкин Д.В., 2017.
11. Оценка инвестиционной привлекательности инновационных программ предприятия авиационной промышленности. Материалы 15-й Международной научно-практической конференции, Санкт-Петербург, с. 102-109. Москвичева Н.В., Никулина Е.Н., Тарасова Е.В., Фомкина В.И., 2016.
12. Разработка модели управления рисками инвестиционных проектов на транспортно-экспедиторском предприятии. Кандидат наук. дипломная работа по экономике. Московский авиационный университет, Москва, 253 с. Никулина, Е.Н. и Тарасова Е.В., 2018.
13. Технология коммерческой и инновационной оценки инвестиционных проектов в авиационной отрасли. Вестник Рыбинского государственного авиационного технического университета им. П.А. Соловьева, 1 (28), 151-157 Никулина, Е.Н. и Тарасова Е.В., 2020
14. Технология оценки инновационной активности предприятий авиационной отрасли. Монография, Москва: МАИ, 176 с. Трошин А.Н., Бурдин А.А., Москвичева Н.В., Тарасова Е.В., Никулина Е.Н., 2020
15. Финансовая математика для инвестора. Монография. М. : МАИ-Принт, 184 с. Спиридонова Е.А., 2020
16. Финансовый менеджмент. Руководство. М. : ИНФРА-М, 331 с. Трошина А.Н., Бурдина А.А., Москвичева Н.В., Никулина Е.Н., Тарасова Е.В., Рогуленко Т.М., 2020
17. Экономическая оценка инвестиций. Руководство. М. : МАИ Принт, 98 с. Никулина, Е.Н. и Тарасова Е.В., 2019.

Эта часть работы выложена в ознакомительных целях. Если вы хотите получить работу полностью, то приобретите ее воспользовавшись формой заказа на странице с готовой работой:

<https://studservis.ru/gotovye-raboty/kurovaya-rabota/187825>