

## Управление инвестиционным портфелем

### Аннотация рабочей программы дисциплины

Закреплена за кафедрой

Кафедра экономика

Квалификация **Магистр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **2 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 72

в том числе:

аудиторные занятия 34,3

самостоятельная работа 37,7

Виды контроля в семестрах:

зачеты 2

Форма обучения **очно-заочная**

Общая трудоемкость **2 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 72

в том числе:

аудиторные занятия 12,3

самостоятельная работа 55,7

часов на контроль 4

Виды контроля в семестрах:

зачеты 2

Форма обучения **заочная**

Общая трудоемкость **2 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 72

в том числе:

аудиторные занятия 8,3

самостоятельная работа 60

часов на контроль 3,7

Виды контроля на курсах:

зачеты 1

**Распределение часов дисциплины по семестрам  
очная форма**

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	<b>2 (1.2)</b>		Итого	
	Неделя		17 2/6	
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	10	10	10	10
Практические	24	24	24	24
Контактная работа на аттестацию	0,3	0,3	0,3	0,3
Итого ауд.	34,3	34,3	34,3	34,3
Контактная работа	34,3	34,3	34,3	34,3
Сам. работа	37,7	37,7	37,7	37,7
Итого	72	72	72	72

**Распределение часов дисциплины по семестрам  
очно-заочная форма**

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	<b>2 (1.2)</b>		Итого	
	Неделя		17 2/6	
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	4	4	4	4
Практические	8	8	8	8
Контактная работа на аттестацию	0,3	0,3	0,3	0,3
Итого ауд.	12,3	12,3	12,3	12,3
Контактная работа	12,3	12,3	12,3	12,3
Сам. работа	55,7	55,7	55,7	55,7
Часы на контроль	4	4	4	4
Итого	72	72	72	72

**Распределение часов дисциплины по семестрам  
заочная форма**

Курс	<b>1</b>		Итого	
	уп	рп	уп	рп
Лекции	2	2	2	2
Практические	6	6	6	6
Контактная работа на аттестацию	0,3	0,3	0,3	0,3
Итого ауд.	8,3	8,3	8,3	8,3
Контактная работа	8,3	8,3	8,3	8,3
Сам. работа	60	60	60	60
Часы на контроль	3,7	3,7	3,7	3,7
Итого	72	72	72	72

## 1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

**Цель** - формирование системы знаний в области управления инвестиционным портфелем, изучение теоретических и икладных основ принятия инвестиционных решений при осуществлении портфельных инвестиций в условиях риска.

**Задачами** учебной дисциплины являются:

- ✓ ознакомление с понятием инвестиционного портфеля, теоретическим содержанием ее роли и значения для эффективной инвестиционной деятельности на рынке ценных бумаг, его фундаментальными проблемами и перспективами развития;
- ✓ усвоение общенаучных методов познания в рамках методологии экономической науки при изучении инвестиционных свойств ценных бумаг для образования инвестиционного портфеля;
- ✓ овладение знаниями основных принципов управления, инвестиционных портфелей, их классификацией инвестиционными свойствами, об основных типах портфельных инвесторов, их мотиваций и склонностей к рискованной инвестиционной деятельности, принципов и форм портфельного инвестирования на рынке ценных бумаг;
- ✓ развитие и представление об основных концепциях и теориях образования, управления и совершенствования, портфелем ценных бумаг и влияние действий портфельных инвесторов на рыночную конъюнктуру рынка ценных бумаг;
- ✓ особенности управления портфеля акций, портфеля облигаций и смешанных портфелей, их общие и специфические свойства;
- ✓ получение основных практических навыков расчета уровня риска и доходности инвестиционных портфелей.

## 2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП:	Б1.В.04
<b>2.1</b>	<b>Требования к предварительной подготовке обучающегося:</b>
2.1.	Адаптация инвалидов и лиц с ОВЗ в образовательной среде вуза
2.1.	Комплексный экономический анализ
2.1.	Теория организации и организационное поведение
<b>2.2</b>	<b>Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:</b>
2.2.	Антикризисное управление
2.2.	Научно-исследовательская работа
2.2.	Практика по профилю профессиональной деятельности
2.2.	Производственная практика
2.2.	Производственная практика
2.2.	Финансовое планирование и бюджетирование
2.2.	Финансовый консалтинг
2.2.	Финансовый мониторинг
2.2.	Защита выпускной квалификационной работы
2.2.	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы
2.2.	Преддипломная практика
2.2.	Формирование организационной культуры и командообразование

## 3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

### ПК-2.1. Разрабатывает и формирует программу исследования

**Знать:** определение и виды проблем, способы опровержения и способы подтверждения гипотез, определение и

**Уметь:** определять объем и содержание понятия, устанавливать отношение между понятиями, производить

**Владеть:** навыками анализа определения, деления, обобщения, ограничения понятий методами установления причинных связей, методами индукции, дедукции, аналогии.

### ПК-2.2. Самостоятельно исследует процессы и явления в финансовой сфере, выявляет тенденции и дает прогнозные оценки

**Знать:** основы оценки, анализа и прогнозирования процессов и явлений в финансовой сфере.

**Уметь:** собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра

**Владеть:** навыками проверки достоверности информации в финансовой сфере с экономической и с юридической

### ПК-4.1. Демонстрирует знания методов финансового консультирования и финансового планирования

**Знать:** основные методы финансового консультирования и финансового планирования

**Уметь:** применять методы финансового консультирования и финансового планирования

**Владеть:** навыками демонстрации знаний методов финансового консультирования и финансового планирования

**В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен**

<b>3.1</b>	<b>Знать:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>- цели, ограничения и риски, возникающие при управлении портфелем ценных бумаг;</li><li>- основные этапы инвестиционного процесса, суть решений, принимаемых на каждом из них, соотношение ответственности клиента и менеджера;</li><li>- проблемы и принципы принятия человеком решений в условиях неопределённости, что такое «предпочтения инвестора»;</li><li>- соотношения между доходностью и риском при инвестировании;</li></ul>
<b>3.2</b>	<b>Уметь:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>- устанавливать соответствие между заявленными целями инвестирования и адекватными им стратегиями управления портфелем;</li><li>- решать простейшую задачу иммунизации портфеля облигаций (для единичного обязательства, с небольшим набором активов);</li><li>- рассчитывать ожидаемую доходность и риск портфеля по известным характеристикам составляющих его активов (ожидаемые доходности, риски, ковариации) и их долям в портфеле;</li><li>- имея оценки для характеристик доходности и риска конкретного актива и рынка в целом, с помощью модели CAPM определять, является ли актив недооцененным или переоцененным;</li><li>- имея необходимые данные о доходности портфеля, а также о рынке в целом и эталонных портфелях, делать обоснованное заключение об эффективности управления портфелем.</li></ul>
<b>3.3</b>	<b>Владеть:</b> <ul style="list-style-type: none"><li>- понятийным аппаратом в области инвестиций в ценные бумаги;</li><li>- понятиями эффективного и оптимального инвестиционного решения;</li><li>- методами формирования оптимального инвестиционного портфеля;</li><li>- методами оценки эффективности инвестирования;</li></ul>