

Управление инвестиционным портфелем фирмы

Аннотация рабочей программы дисциплины

Закреплена за кафедрой **Кафедра экономики**

Квалификация **Магистр**

Форма обучения **очная**

Общая трудоемкость **5 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	180	Виды контроля в семестрах: экзамены 4
в том числе:		
аудиторные занятия	49,6	
самостоятельная работа	94	
часов на контроль	34,4	

Форма обучения **очно-заочная**

Общая трудоемкость **5 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	180	Виды контроля в семестрах: экзамены 5
в том числе:		
аудиторные занятия	19,6	
самостоятельная работа	151,4	
часов на контроль	9	

Форма обучения **заочная**

Общая трудоемкость **5 ЗЕТ**

Часов по учебному плану	180	Виды контроля на курсах: экзамены 2
в том числе:		
аудиторные занятия	17,6	
самостоятельная работа	155	
часов на контроль	7,4	

**Распределение часов дисциплины по семестрам
очная форма**

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	4 (2.2)		Итого	
	Неделя			
Неделя	8 2/6			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	16	16	16	16
Практические	32	32	32	32
Консультации	2	2	2	2
Контактная работа на аттестацию	1,6	1,6	1,6	1,6
Итого ауд.	49,6	49,6	49,6	49,6
Контактная работа	51,6	51,6	51,6	51,6
Сам. работа	94	94	94	94
Часы на контроль	34,4	34,4	34,4	34,4
Итого	180	180	180	180

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

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	5 (3.1)		Итого	
	Неделя			
Неделя	8 4/6			
Вид занятий	уп	рп	уп	рп
Лекции	6	6	6	6
Практические	12	12	12	12
Контактная работа на аттестацию	1,6	1,6	1,6	1,6
Итого ауд.	19,6	19,6	19,6	19,6
Контактная работа	19,6	19,6	19,6	19,6
Сам. работа	151,4	151,4	151,4	151,4
Часы на контроль	9	9	9	9
Итого	180	180	180	180

**Распределение часов дисциплины по семес
заочная форма**

Курс	2		Итого	
	уп	рп		
Лекции	4	4	4	4
Практические	12	12	12	12
Контактная работа на аттестацию	1,6	1,6	1,6	1,6
Итого ауд.	17,6	17,6	17,6	17,6
Контактная работа	17,6	17,6	17,6	17,6
Сам. работа	155	155	155	155
Часы на контроль	7,4	7,4	7,4	7,4
Итого	180	180	180	180

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цель: получение обучающимися современных знаний в области управления инвестиционным портфелем, а также приобретение навыков консультирования клиентов по формированию целевого инвестиционного портфеля.

Задачи:

- сформировать у обучающихся базовые знания об инвестициях и методике разработки инвестиционной стратегии;
- научить измерять инвестиционный доход и риск, оценивать инвестиционные инструменты и управлять инвестиционным портфелем;
- привить практические навыки проведения финансовых консультаций по широкому спектру финансовых услуг и разработки для клиента целевого инвестиционного портфеля.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ) В СТРУКТУРЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЙ ПРОГРАММЫ

Цикл (раздел) ОП:		Б1.В
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Практика по профилю профессиональной деятельности	
2.1.2	Теория игр и стратегическое поведение	
2.1.3	Управление стратегическими изменениями в организациях	
2.1.4	Анализ в управлении финансовым состоянием коммерческой организации	
2.1.5	Инновационный менеджмент	
2.1.6	Корпоративное право	
2.1.7	Стратегический менеджмент	
2.1.8	Антикризисное управление	
2.1.9	Корпоративные финансы	
2.1.10	Налоговая система РФ	
2.1.11	Практика эконометрических исследований в менеджменте	
2.1.12	Специализированный адаптационный курс по Стратегическому менеджменту	
2.1.13	Финансовое и налоговое планирование	
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	

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

ПК-1.3: Разрабатывает систему финансово-экономических показателей организации

Знать: методы сбора и обработки экономической информации;

Уметь: осуществлять технико-экономические расчеты и анализ хозяйственной деятельности организации;

Владеть: навыками составления и анализа финансово-экономическую отчетность организации;

ПК-4.1: Использует основные подходы к формированию эффективных корпоративных стратегий в различных сферах и видах бизнеса

Знать: эффективные корпоративные стратегии в различных сферах и видах бизнеса;

Уметь: применять эффективные корпоративные стратегии в различных сферах и видах бизнеса;

Владеть: навыками анализа и экспертной при использовании основных подходов к формированию

ПК-6.2: Осуществляет поиск и обработку информации для определения перспектив и тенденций развития экономических систем на основе анализа тенденций развития рынка

Знать: базовые принципы эффективной управленческой деятельности, методы анализа существующих

Уметь: анализировать влияние принимаемых управленческих решений на социально-экономическое

Владеть: навыками исследования управленческой

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен

3.1	Знать: <ul style="list-style-type: none"> ✓ - цели, ограничения и риски, возникающие при управлении портфелем ценных бумаг; ✓ - основные этапы инвестиционного процесса, суть решений, принимаемых на каждом из них, соотношение ответственности клиента и менеджера; ✓ - проблемы и принципы принятия человеком решений в условиях неопределённости, что такое «предпочтения инвестора»; ✓ - соотношения между доходностью и риском при инвестировании;
------------	---

3.2	<p>Уметь:</p> <ul style="list-style-type: none"> ✓ - устанавливать соответствие между заявленными целями инвестирования и адекватными им стратегиями управления портфелем; ✓ - решать простейшую задачу иммунизации портфеля облигаций (для единичного обязательства, с небольшим набором активов); ✓ - рассчитывать ожидаемую доходность и риск портфеля по известным характеристика составляющих его активов (ожидаемые доходности, риски, ковариации) и их долям в портфеле; ✓ - имея оценки для характеристик доходности и риска конкретного актива и рынка в целом, с помощью модели CAPM определять, является ли актив недооцененным или переоцененным; ✓ - имея необходимые данные о доходности портфеля, а также о рынке в целом и эталонных портфелях, делать обоснованное заключение об эффективности управления портфелем.
3.3	<p>Владеть:</p> <ul style="list-style-type: none"> ✓ - понятийным аппаратом в области инвестиций в ценные бумаги; ✓ - понятиями эффективного и оптимального инвестиционного решения; ✓ - методами формирования оптимального инвестиционного портфеля; ✓ - методами оценки эффективности инвестирования;