

Частное образовательное учреждение высшего образования
"Курский институт менеджмента, экономики и бизнеса"

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе

_____ Н.А.Еськова

31 августа 2023 г.

Управление инвестиционным портфелем
Аннотация
рабочей программе дисциплины

Закреплена за кафедрой	Кафедра экономика		
Квалификация	Магистр		
Форма обучения	очная		
Общая трудоемкость	3 ЗЕТ		
Часов по учебному плану	108	Виды контроля	в семестрах:
в том числе:		зачет	1
аудиторные занятия	34,3		
самостоятельная работа	73,7		
часов на контроль	0		
Форма обучения	очно-заочная		
Общая трудоемкость	3 ЗЕТ		
Часов по учебному плану	108	Виды контроля	в семестрах:
в том числе:		Зачет	1
аудиторные занятия	12,3		
самостоятельная работа	91,7		
часов на контроль	4		
Форма обучения	заочная		
Общая трудоемкость	3 ЗЕТ		
Часов по учебному плану	108	Виды контроля на курсах:	
в том числе:		Зачет	1
аудиторные занятия	8,3		
самостоятельная работа	96		
часов на контроль	3,7		

**Распределение часов дисциплины по семестрам
очная форма**

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	1 (1.1)		Итого	
	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	73,7	73,7	73,7	73,7
Часы на контроль				
Итого	108	108	108	108

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

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	1 (1.1)		Итого	
	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	91,7	91,7	91,7	91,7
Часы на контроль	4	4	4	4
Итого	108	108	108	108

**Распределение часов дисциплины по семестрам
заочная форма**

Курс	1		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	96	96	96	96
Часы на контроль	3,7	3,7	3,7	3,7
Итого	108	108	108	108

1. ЦЕЛИ И ЗАДАЧИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Цель - формирование системы знаний в области управления инвестиционным портфелем, изучение теоретических 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 теорий 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
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Управленческая экономика	
2.1.2	Менеджмент государственных и муниципальных финансов	
2.1.3	Стратегия и тактика финансового управления	
2.1.4	Инвестиционный менеджмент и анализ	
2.2	Дисциплины (модули) и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Финансовый менеджмент (продвинутый уровень)	
2.2.2	Финансовое и налоговое планирование в организации	
2.2.3	Анализ денежных потоков	
2.2.4	Анализ финансовых рынков	
2.2.5	Международные финансы в условиях глобализации	
2.2.6	Финансовый анализ (продвинутый уровень)	

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

УК-2.2: Демонстрирует способность разрабатывать и анализировать альтернативные варианты проектов для достижения намеченных результатов; разрабатывать проекты, определять целевые этапы и основные направления работ

Знать: основы разработки альтернативных вариантов проектов;

Уметь: определять целевые этапы и основные направления работ при управлении проектами;

Владеть: навыками разработки и анализа альтернативных вариантов проектов для достижения намеченных результатов;

ПК-2.2: Разрабатывает план реализации финансового решения, формирования инвестиционного портфеля, оказания финансовых услуг, финансового инжиниринга

Знать: современные методики оценки результативности и экономической эффективности управления инвестиционным портфелем;

Уметь: осуществлять мониторинг результативности управления инвестиционным портфелем;

Владеть: навыками финансового инжиниринга

ПК-2.3: Анализирует и оценивает параметры риска, доходности финансового решения и инвестиционного портфеля

Знать: современные тенденции развития международной и российской теории и практики управления рисками;

Владеть:

Уметь: определять приоритетные направления и сферы деятельности, подверженные наибольшим рискам;

Владеть: навыками разработки стратегий развития систем управления рисками на основе современных методов и передовых достижений;

В результате освоения дисциплины (модуля) обучающийся должен

3.1	<p>Знать:</p> <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 характеристикам 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;