

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:

ФИО: Задорожная Людмила Ивановна

Должность: Проректор по учебной работе

Дата подписания: 08.08.2025 23:13:12

Университет: Программа: ИИ

faa404d1aeb2a023b5f4a331ee5ddc540496512d

рабочей программы учебной дисциплины "ФТД.01 Инвестиции в финансовые активы"

направления подготовки бакалавров "38.04.08 Финансы и кредит"

профиль подготовки "Искусственный интеллект в финансово-экономических системах"

программа подготовки "магистр"

Цели и задачи учебной дисциплины (модуля)

Главной целью изучения студентами дисциплины «Инвестиции в финансовые активы» является освоение принципов, форм, методов инвестиционной, инновационной деятельности субъектов хозяйствования, находящихся в условиях рыночной экономики.

Задачами изучения дисциплины являются:

- дать представление об объектах и субъектах финансового инвестирования в условиях рыночной экономики;
- изучить базовые основы и концепции современной теории инвестиций;
- ознакомить обучающихся с новейшими методами анализа финансовых инструментов и прогнозирования их стоимости;
- сформировать прикладные навыки построения инвестиционных стратегий и управления инвестиционным портфелем;
- рассмотреть основные направления использования финансовых инструментов для управления рисками предприятия.

Основные блоки и темы дисциплины

Раздел дисциплины
Основные области применения ИИ в инвестициях
Финансовые активы с фиксированным доходом
Финансовые активы с переменным доходом
Портфельная теория и модели стоимости финансовых активов
Роль искусственного интеллекта (ИИ) в формировании и управлении инвестиционным портфелем.

Место дисциплины в структуре ОП

Данная дисциплина ФТД.01 «Инвестиции в финансовые активы» относится к факультативным дисциплинам по направлению подготовки "Финансы и кредит", программа магистратуры «Искусственный интеллект в финансово-экономических системах» и основой для изучения дисциплины являются знания, полученные на предыдущей ступени образования.

Изучению дисциплины «Инвестиции в финансовые активы» предшествует изучение следующих дисциплин: «Финансовые рынки», «Введение в финансовые инструменты», «Фундаментальный и технический анализ на финансовых рынках». Они позволяют использовать полученные знания о системе экономических отношений и процессов на макро- и микро- уровнях, их регламентировании, организации и содержании управления, методах получения, анализа и обработки информации.

Знания, получение при изучении дисциплины «Инвестиции в финансовые активы» необходимы как базовые для дальнейшего более глубокого изучения экономических отношений на макро- и микро- уровнях в курсах: «Инвестиционная деятельность организации», «Корпоративные финансы», «Управление рыночными и кредитными рисками».



В результате изучения дисциплины бакалавр должен обладать следующими компетенциями:

УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий		
УК-1.1 Анализирует задачу, выделяя ее базовые составляющие, осуществляет декомпозицию задачи		
логические формы и процедуры, способствующие рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности	аргументированно формировать собственное суждение и оценку информации	навыками сопоставления разных источников информации с целью выявления их противоречий и поиска достоверных суждений
УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий		
УК-1.2 Находит и критически анализирует информацию, необходимую для решения поставленной задачи		
- особенности системного и критического мышления и демонстрировать готовность к нему;- логические формы и процедуры, демонстрировать способность к рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности.	анализировать источники информации с точки зрения временных и пространственных условий их возникновения	навыками определения практических последствий изложенного решения задачи
УК-1: Способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, вырабатывать стратегию действий		
УК-1.3 Рассматривает возможные варианты решения задачи, оценивая их достоинства и недостатки		
логические формы и процедуры, способствующие рефлексии по поводу собственной и мыслительной деятельности	аргументированно формировать собственное суждение и оценку информации	навыками определения практических последствий изложенного решения задачи
ПКУВ-1: Способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля		
ПКУВ-1.1 Консультирует по широкому спектру финансовых услуг		
широкий спектр финансовых продуктов и услуг; экономические и юридические аспекты инвестиционной и страховой деятельности; основные финансовые организации и профессиональных участников банковской системы	осуществлять подбор финансовых продуктов и услуг; предоставлять клиенту качественные профессиональные услуги, ориентированные на потребности и интересы клиента; собирать, анализировать и предоставлять достоверную информацию в масштабах всего спектра экономических и финансовых услуг	навыками проведения консультаций по вопросам оказания финансовых услуг, в том числе о состоянии и перспективах рынка, современных тенденциях в экономике и финансах
ПКУВ-1: Способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля		
ПКУВ-1.2 Разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель		
основные принципы финансовой математики, принципы портфельного управления инвестированием	оценивать затраты на поведение финансовых операций; рассчитывать величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; выявлять соответствие/несоответствие инвестиционного профиля клиента параметрам инвестиционного портфеля; рассчитывать размер инвестиций, необходимый для достижения целей клиентов; рассчитывать целевую доходность в зависимости от финансовых целей и начального капитала	навыками составления инвестиционного портфеля; выявления качественных и количественных свойств рисков в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Дисциплина "Инвестиции в финансовые активы" изучается посредством лекций, все разделы программы закрепляются практическими, лабораторными занятиями, выполнением контрольных работ, самостоятельной работы над учебной и научно-технической литературой и завершается экзаменом.

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 71.75 часа, 2 зачетные единицы.

Вид промежуточной аттестации: Зачет.

Разработчик:

Подписано простой ЭП 18.06.2025

Мамиек Людмила Алиевна

Зав. кафедрой:

Подписано простой ЭП 21.06.2025

Пригода Людмила Владимировна

Зав. выпускающей кафедрой:

Подписано простой ЭП 21.06.2025

Пригода Людмила Владимировна



