

программа подготовки "магистр"

Целью изучения учебной дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» является усвоение теоретических и практических основ формирования инвестиционного портфеля и управления им для достижения оптимальных соотношений доходности и риска, связанных с инвестиционными решениями.

- изучение сущности и видов инвестиций в целом, а также портфельных инвестиций в частности;

- изучение количественных характеристик различных видов ценных бумаг с использованием традиционных моделей ценообразования на фондовом рынке;

- изучение стратегических и тактических приемов управления различными видами инвестиционных портфелей, а также возможности комплексного управления комбинированным портфелем ценных бумаг.

Раздел дисциплины
Методологические основы портфельного инвестирования, экономическая сущность и формы
Портфельные инвестиции. Принципы формирования инвестиционного портфеля
Типы инвестиционных портфелей
Основные стратегии управления инвестиционным портфелем
Оценка ценных бумаг
Формирование оптимального портфеля инвестиций
Проблемы портфельного инвестирования в условиях российского рынка
Промежуточная аттестация (зачет)

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» является дисциплиной магистерской программы «Экономика».

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» относится к числу дисциплин, позволяющих сформировать у будущих магистров комплексное представление о вложении денежных средств в ценные бумаги, об инвестиционной политике, управлении инвестиционным портфелем, методах выбора оптимальной структуры инвестирования.

Данный курс играет большую роль в подготовке магистров в области финансового менеджмента и управление малым бизнесом, обеспечения их необходимыми теоретическими знаниями и практическими навыками в области вложений денежных средств в ценные бумаги, разработки инвестиционной политики, приемами управления инвестиционным портфелем, методами выбора оптимальной структурой инвестирования как на национальном, так и на международном уровне.

Изучение дисциплины включает курс лекций, практические занятия. Особенностью проведения семинарских занятий по данному курсу является значительный объем расчетов по определению риска и доходности ценных бумаг, инвестиционного портфеля, выбору и



отбору портфеля, иммунизации облигационного портфеля, сравнению и оценке инвестиционных портфелей, оценка эффективности инвестиционных проектов.

В результате изучения дисциплины бакалавр должен обладать следующими компетенциями:

ПКУВ-4: Способен управлять процессом финансового консультирования в организации (подразделении)		
ПКУВ-4.1 Организует структуру финансового консультирования в организации (подразделении)		
основные подходы к осуществлению организационных изменений; корпоративные документы и нормативные акты; механизмы и система внутренней и внешней коммуникации и отчетности в организации.	оценивать ресурсы, необходимые для создания организационной структуры по финансовому консультированию в организации; руководить разработкой и разрабатывать документацию и положения об организационной структуре, предоставляющей услуги финансового консультирования клиентам; организовывать командное взаимодействие для решения поставленных задач.	навыками планирования деятельности подразделения по финансовому консультированию; организации, курирования и контроля деятельности подразделения по финансовому консультированию; организации разработки и утверждение положения о подразделении по финансовому консультированию; создания системы мотивации и развития персонала, отвечающего за финансовое консультирование
ПКУВ-1: Способен строить интегрированную систему управления рисками и осуществлять поддержку и координацию процесса управления рисками		
ПКУВ-1.1 Демонстрирует способность осуществлять планирование, координирование и нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками		
принципы целеполагания, организационного планирования и прогнозирования, Законодательство Российской Федерации и локальные нормативные акты в организации по управлению рисками; п и компоненты системы управления рисками.	внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения; разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками; описывать бизнес-процессы с учетом рисков; вырабатывать рекомендации по принятию решений в сфере управления рисками в рамках подразделения; использовать программное обеспечение для работы с экономической информацией.	навыками реализации плана построения системы управления рисками.
ПКУВ-6: Способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля		
ПКУВ-6.2 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.
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.
ПКУВ-1: Способен строить интегрированную систему управления рисками и осуществлять поддержку и координацию процесса управления рисками		
ПКУВ-1.1 Демонстрирует способность осуществлять планирование, координирование и нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками		
принципы целеполагания, организационного планирования и прогнозирования, Законодательство Российской Федерации и локальные нормативные акты в организации по управлению рисками; п и компоненты системы управления рисками.	внедрять системы управления рисками на уровне организации, подразделения; разрабатывать регламентирующие документы по управлению рисками; описывать бизнес-процессы с учетом рисков; вырабатывать рекомендации по принятию решений в сфере	навыками реализации плана построения системы управления рисками.



	управления рисками в рамках подразделения; использовать программное обеспечение для работы с экономической информацией.	
ПКУВ-4: Способен управлять процессом финансового консультирования в организации (подразделении)		
ПКУВ-4.1 Организует структуру финансового консультирования в организации (подразделении)		
основные подходы к осуществлению организационных изменений; корпоративные документы и нормативные акты; механизмы и система внутренней и внешней коммуникации и отчетности в организации.	оценивать ресурсы, необходимые для создания организационной структуры по финансовому консультированию в организации; руководить разработкой и разрабатывать документацию и положения об организационной структуре, предоставляющей услуги финансового консультирования клиентам; организовывать командное взаимодействие для решения поставленных задач.	навыками планирования деятельности подразделения по финансовому консультированию; организации, курирования и контроля деятельности подразделения по финансовому консультированию; организации разработки и утверждения положения о подразделении по финансовому консультированию; создания системы мотивации и развития персонала, отвечающего за финансовое консультирование
ПКУВ-6: Способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля		
ПКУВ-6.2 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 "Управление инвестиционным портфелем" 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 108 часа, 3 зачетные единицы.

Вид промежуточной аттестации: Зачет.

Разработчик:	Подписано простой ЭП 21.05.2024	Намиотокова Зарема Шхамбиевна
Зав. кафедрой:	Подписано простой ЭП 02.06.2024	Пригода Людмила Владимировна
Зав. выпускающей кафедрой:	Подписано простой ЭП 02.06.2024	Пригода Людмила Владимировна

