

## Аннотация

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:

ФИО: Подержина Людмила Ивановна

Должность: Проректор по учебной работе

Дата подписания: 11.09.2024 19:39:28

Уникальный программный ключ:

fa4902202401496512d

**рабочей программы учебной дисциплины "Б1.В.ДВ.05.01 Управление инвестиционным портфелем"**  
**направления подготовки бакалавров "38.04.01 Экономика"**  
**профиль подготовки "Профиль подготовки"**

**программа подготовки "магистр"**

### Цели и задачи учебной дисциплины (модуля)

**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.

Основными **задачами** изучения учебной дисциплины являются:

- 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.

### Основные блоки и темы дисциплины

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)

### Место дисциплины в структуре ОП

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:**

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 16.07.2022	Намитокова Зарема Шхамбиевна
Зав. кафедрой:	<hr/> Подписано простой ЭП 17.07.2022	Пригода Людмила Владимировна
Зав. выпускающей кафедрой:	<hr/> Подписано простой ЭП 17.07.2022	Пригода Людмила Владимировна

