

Аннотация

*учебной дисциплины «Б1.В.ДВ.05.02 Управление инвестиционным портфелем»
направления подготовки 38.04.01 Экономика*

Дисциплина учебного плана подготовки магистров по направлению 38.04.01 Экономика; магистерская программа «Экономика фирмы и отраслевых рынков».

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:

Методологические основы портфельного инвестирования, экономическая сущность и формы, портфельные инвестиции, принципы формирования инвестиционного портфеля, типы инвестиционных портфелей, содержимое инвестиционного портфеля, инвестиционные стратегии и управление инвестиционным портфелем, проблемы портфельного инвестирования в условиях Российского рынка, оценка эффективности инвестиционных проектов.

Учебная дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» входит в перечень дисциплин по выбору вариативной части ОП.

Знания, полученные по дисциплине «Управление инвестиционным портфелем», непосредственно используются при изучении дисциплин «Методы системного исследования экономических процессов», «Экономика фирмы (продвинутый уровень)», «Бизнес-планирование (продвинутый уровень)».

Дисциплина формирует следующие компетенции:

- способен осуществлять критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий (УК-1);
- анализирует проблемную ситуацию как целостную систему, выявляя ее составляющие и связи между ними (УК-1.1);
- способен строить интегрированную систему управления рисками и осуществлять поддержку и координацию процесса управления рисками (ПКУВ-1);
- демонстрирует способность осуществлять планирование, координирование и нормативное обеспечение интегрированной комплексной деятельности подразделений по управлению рисками (ПКУВ-1.1);
- способен управлять процессом финансового консультирования в организации (подразделении) (ПКУВ-4);
- использует методы управления процессом финансового консультирования в организации (подразделении) (ПКУВ-4.1);

- способен осуществлять консультирование клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля (ПКУВ-6);

- разрабатывает финансовый план для клиента, формирует целевой инвестиционный портфель (ПКУВ-6.2).

В результате изучения дисциплины обучающийся должен:

знать: сущность, общеэкономическое значение и особенности инвестирования в ценные бумаги; современные концепции портфельного анализа, теории оптимизации инвестиционного портфеля (УК-1, ПКУВ-1, ПКУВ-4, ПКУВ-6);

уметь: определять эффективность инвестиционного проекта; определять риск и доходность инвестиционного портфеля; применять методы и принципы формирования инвестиционного портфеля; выявлять необходимость и степень реструктуризации портфеля из ценных бумаг; выделять инвестиционные качества финансовых инструментов; анализировать международные портфельные инвестиции (УК-1, ПКУВ-1, ПКУВ-4, ПКУВ-6);

владеть: понятиями эффективного и оптимального инвестиционного решения; методами формирования оптимального инвестиционного портфеля; методами оценки эффективности инвестирования; навыками самостоятельной исследовательской работы (УК-1, ПКУВ-1, ПКУВ-4, ПКУВ-6).

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» изучается посредством лекций, все разделы программы закрепляются практическими занятиями, выполнением контрольных работ, самостоятельной работы над учебной и научной литературой и завершается зачетом.

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часов).

Вид промежуточной аттестации: зачет.

Разработчик:

канд. экон. наук, доц.  _____ З.Ш. Намитокова

Зав. выпускающей кафедрой
по направлению _____



Л.В. Пригода