

## АННОТАЦИЯ

дисциплины Б1.В.ДВ.06.01 « Инвестиционные стратегии и управление портфелем финансовых активов»

**Объем трудоемкости:** 2 зачетные единицы (72 часа, из них – контактной работы – 10,2 ч., в том числе аудиторной -10 ч: лекционных 2 ч., практических 8 ч.; ИКР – 0,2 ч.; 58 часа самостоятельной работы, контроль – 3,8 ч.)

### **Цель дисциплины:**

сформировать системное представление об управлении портфелем финансовых активов с использованием основных инвестиционных стратегий и подходов к оптимизации портфеля ценных бумаг в банке на основе методов аналитической работы, связанных с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм.

### **Задачи дисциплины:**

1. познакомить с результатами современных исследований в области финансового инвестирования банками;
2. рассмотреть основные инвестиционные стратегии управления портфелем финансовых активов;
3. изучить научные подходы к оценке доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в ценные бумаги и портфель ценных бумаг в банках на основе оценки инвестиционной привлекательности объектов и финансовой эффективности инвестирования;
4. сформировать знания в области методики анализа и методов оценки экономической информации о финансовых аспектах деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм для проведения финансовых расчетов и обоснования принимаемых управленческих решений в области управления портфелем финансовых активов, в том числе в банках;
5. выработать навыки аналитической работы по оценке финансовых аспектов деятельности коммерческих организаций на основе анализа финансовой отчетности и обоснования принимаемых управленческих решений при формировании портфеля ценных бумаг;
6. изучить основные методы анализа и механизмы управления финансовыми рисками в банках;
7. сформировать компетенции по управлению портфелем финансовых активов на основе стратегий с учетом финансового анализа деятельности организаций различных организационно-правовых форм.

### **Место дисциплины в структуре ООП ВО**

Дисциплина «Инвестиционные стратегии и управление портфелем финансовых активов» относится к дисциплине по выбору в вариативной части Блока 1 учебного плана по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов первого года обучения магистерской программы «Финансы и кредит», читается в семестре В 6 курса.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты», «Риск-менеджмент», изучаемой в рамках магистерской подготовки.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплин «Актуальные проблемы финансов», другие дисциплины, при прохождении производственной практики и написании магистерской диссертации

### **Требования к уровню освоения дисциплины**

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций: ПК-1

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-1	<b>(часть компетенции)- способность владеть методами аналитической работы, связанными с финансовым и аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления.</b>	- методы аналитической работы с финансовыми показателями деятельности коммерческих организаций; - методы оценки инвестиционной привлекательности и объектов и финансовой эффективности инвестирования; - показатели оценки эффективности инвестиционных вложений.	- анализировать финансовую эффективность организации с целью формирования и управления портфелем финансовых активов; - применять показатели оценки финансовой эффективности инвестиционных вложений; – применять методы анализа финансовой отчетности при формировании портфеля ценных бумаг.	- методами аналитической работы с финансовыми показателями деятельности организаций для формирования портфеля финансовых активов; - методами анализа доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в ценные бумаги и портфель ценных бумаг;

### Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
Разделы дисциплины, изучаемые в В семестре

№ раздела	Наименование разделов	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Самостоятельная работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1	2	3	4	5	6	7
1.	Общая характеристика объектов и субъектов инвестирования в банках.	4		-		4
2.	Финансовые риски: сущность, подходы к анализу.	12		2		10

3.	Инвестиционный портфель банка: сущность, типы, оценка эффективности.	16		2		14
4.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем ценных бумаг банка.	21	2	3		16
5.	Практические аспекты портфельного инвестирования. Проблемы портфельного инвестирования.	15	-	1		14
	<i>Итого по дисциплине:</i>		2	8	-	58

**Курсовые работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** зачет

**Основная литература:**

1. Мамий Е.А., Пышнограй А.П., Новиков А.В. Инвестиции: учебник / Е.А. Мамий, А.П. Пышнограй, А.В. Новиков, под ред. Е.А. Мамий. – Краснодар: Просвещение-Юг, 2016.-517 с.

2. Шарп, Уильям Ф. Инвестиции [Текст] : [учебник для использования в учебном процессе студентами вузов, обучающимися по экономическим специальностям / У. Ф. Шарп, Г. Дж. Александер, Дж. В. Бэйли ; пер. с англ. [А. Н. Буренина, А. А. Васина]. - М. : ИНФРА-М, 2012. - 1027 с. : ил. - (Университетский учебник) (Бакалавриат). - Библиогр. в конце глав. - ISBN 9785160025957. - ISBN 0131833448.

3. Алиев, А.Т. Управление инвестиционным портфелем [Электронный ресурс] : учеб. пособие / А.Т. Алиев, К.В. Сомик. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2017. — 160 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/93423> .

4. Основы портфельного инвестирования : учебник для бакалавриата и магистратуры / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — М. : Издательство Юрайт, 2018. — 195 с. — (Серия : Бакалавр и магистр. Академический курс). — ISBN 978-5-534-07092-7. — Режим доступа : [www.biblio-online.ru/book/125FBCD7-ED62-4AF7-8BF5-2EA92A540444](http://www.biblio-online.ru/book/125FBCD7-ED62-4AF7-8BF5-2EA92A540444) .

Автор РПД

Мамий Е.А.