

АННОТАЦИЯ
Дисциплины Б1.В.10
«Управление инвестиционным портфелем финансовых активов»

Направление подготовки 38.04.08 – Финансы и кредит

Направленность (профиль) / специализация "Финансы в цифровой экономике"

Форма обучения - очная

Объем трудоемкости: 2 зачетные единицы (72 часа, из них – 26,2 ч. контактной работы, в том числе 22 часа аудиторной нагрузки: лекционных 6 ч., практических 20 ч.; ИКР-0,2 ч; 45,8 часов самостоятельной работы)

Цель дисциплины

сформировать у магистрантов современные компетенции в области управления портфелем финансовых активов с использованием основных инвестиционных стратегий и подходов к формированию и оптимизации портфеля ценных бумаг в условиях цифровизации экономики, определяющие основу для принятия научно обоснованных управленческих решений и оперативного решения практических задач управления финансовыми потоками коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм.

Задачи дисциплины:

- 1) изучить актуальные данные по результатам научных исследований и практических разработок в области финансового портфельного инвестирования;
- 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 сформированных на их основе портфелей финансовых активов;
- 4) освоить методы оценки и анализа 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 условиях цифровой экономики;
- 5) выработать навыки аналитической работы по оценке финансовых аспектов деятельности коммерческих организаций и обоснования принимаемых управленческих решений при формировании портфеля ценных бумаг;
- 6) изучить основные методы анализа и механизмы управления финансовыми рисками в условиях цифровизации технологических процессов при формировании портфеля финансовых активов;
- 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 «Управление инвестиционным портфелем финансовых активов» относится к дисциплинам в вариативной части Блока 1 учебного плана по направлению подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» (квалификация (степень) «магистр»). Дисциплина предназначена для студентов магистерской программы «Финансы и кредит», читается в 3 семестре 2 курса.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин «Технический и фундаментальный анализ финансовых рынков», «Управление инвестиционными проектами», «Инфокоммуникативное обеспечение финансового рынка», изучаемых в рамках магистерской подготовки.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплин «Биржевая торговля и биржевые инструменты», «Производные финансовые инструменты: анализ рынка, хеджирование и арбитраж» и других, а также при прохождении производственной практики и написании магистерской диссертации

Требования к уровню освоения дисциплины

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся профессиональных компетенций

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1.	ПК-1	способностью владеть методами аналитической работы, связанными с финансовыми аспектами деятельности коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно-правовых форм, в том числе финансово-кредитных, органов государственной власти и местного самоуправления	<ul style="list-style-type: none"> - методы аналитической работы с финансовыми показателями деятельности коммерческих организаций; - методы оценки инвестиционной привлекательности инвестиционных активов в условиях цифровизации; - показатели эффективности инвестиционных вложений. 	<ul style="list-style-type: none"> - 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. 	<ul style="list-style-type: none"> - 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;
2.	ПК-23	способностью выявлять и проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками	<ul style="list-style-type: none"> - понятийно-терминологический аппарат, характеризующий экономические риски в деятельности хозяйствующих субъектов; - методы исследования экономических рисков портфелей финансовых 	<ul style="list-style-type: none"> - проводить исследование финансово-экономических рисков деятельности хозяйствующих субъектов и разрабатывать систему управления рисками. 	<ul style="list-style-type: none"> -методами решения практических задач в области исследования и управления рисками с использованием цифровых технологий.

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
			активов в условиях цифровизации для разработки системы управления рисками		

Основные разделы дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.

Разделы дисциплины, изучаемые в 3 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 условиях цифровой экономики	6	-	2	-	4
2.	Финансовые риски: сущность, подходы к анализу.	12	-	4	-	8
3.	Инвестиционный портфель: сущность, типы, оценка эффективности.	14	2	4	-	8
4.	Концептуальные основы управления финансовыми активами	11	1	2	-	8
5.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем ценных бумаг.	14,8	1	4	-	9,8
6.	Практические аспекты портфельного инвестирования в условиях цифровизации.	14	2	4	-	8
	<i>Итого по дисциплине:</i>	-	6	20	-	45,8

Лабораторный практикум - не предусмотрен.

Курсовые проекты или 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 .

Автор РПД

А.П. Пышнограй