

## АННОТАЦИЯ

### Дисциплины *Б1.В.20* «УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМИ РИСКАМИ»

Направление 38.03.02 Менеджмент  
Профиль Финансовый менеджмент

**Объем трудоемкости для ЗФО:** 2 зачетные единицы (72 часа, из них 12,2 ч. контактная работа, в том числе 12 ч. аудиторной нагрузки: лекционных 4 ч., практических 8 ч.; 56 ч. самостоятельной работы)

#### Цель дисциплины

– сформировать системное представление об управлении инвестиционными рисками портфеля финансовых активов с использованием основных инвестиционных стратегий и подходов к оптимизации портфеля ценных бумаг, направленное на формирование компетенций в области финансовых инвестиций.

#### Задачи дисциплины:

1. Изучить методы оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов
2. Изучить теоретические основы инвестиции и инвестиционной деятельности;
3. Изучить нормативно-правовое обеспечение и регулирование инвестиционной деятельности на территории РФ;
4. Овладеть методическими основами инвестиционного анализа, современными методами и приемами анализа инвестиционных рисков, а также оценки финансовой и экономической эффективности инвестиционных проектов;
5. Сформировать компетенции в области оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов, а также анализа рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании анализа.

#### Место дисциплины в структуре ООП ВО

Дисциплина «Управление инвестиционными рисками» относится к вариативной части Блока 1 учебного плана. Дисциплина предназначена для студентов четвертого года обучения направления «Менеджмент», читается в Летнюю сессию и зимнюю сессию 4 курса. Дисциплина читается после ряда гуманитарных, математических, общеэкономических и специальных дисциплин, позволяющих наиболее эффективно усваивать учебный материал в рамках данного курса. Предполагается также, что студенты обладают базовыми знаниями и навыками в области «Теории статистики», «Общей экономической теории», «Финансов и кредита», «Основ менеджмента», «Инвестиционный анализ», «Инвестиции», полученными в ходе обучения на 1-3 курсах обучения.

Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, являются необходимой базой для изучения таких дисциплин как «Методы финансово-кредитных расчетов», «Стратегическое управление», «Управление инвестиционными рисками» и используются при выполнении выпускной квалификационной работы и направлены на формирование профессиональных компетенций в области оценки эффективности инвестиционных проектов.

#### Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование следующих компетенций:  
ПК-15, ПК-16

№ п.п.	Индекс компетенции	Содержание компетенции (или её части)	В результате изучения учебной дисциплины обучающиеся должны		
			знать	уметь	владеть
1	ПК-15	умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании	- методы рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании анализа	- применять методы рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании анализа	- методами рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решений об инвестировании и финансировании анализа
2	ПК-16	владением навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	- методы оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов	- использовать методы оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов.	- владеть практическими навыками использования методов оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов.

### Основные разделы дисциплины

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины (ЗФО).

№ раз-дела	Наименование тем	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа
			Л	ПЗ	ЛР	СРС
1	2	3	4	5	6	7
1.	Общая характеристика объектов и субъектов инвестирования.	6	1	1	-	4
2.	Финансовые риски: сущность, подходы к анализу.	9	1	2	-	6
3.	Инвестиции в ценные бумаги.	10	-	-	-	8
4.	Методы и формы финансирования инвестиций.	8	-	-	-	8
5.	Понятие и сущность риска, подходы к оценке инвестиционных рисков.	13	1	2	-	10
6.	Инвестиционный портфель: сущность, типы, оценка эффективности.	5	-	1	-	4
7.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем.	8	1	1	-	6
8.	Практические аспекты портфельного инвестирования. Проблемы портфельного инвестирования.	11	-	1	-	10
<i>Итого по дисциплине:</i>			4	8	-	56

**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. – 48 экз

2. Блау, С.Л. Инвестиционный анализ [Электронный ресурс] : учебник / С.Л. Блау. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2016. — 256 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/93281>. — Загл. с экрана.

3. Нешиной, А.С. Инвестиции [Электронный ресурс] : учеб. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2016. — 352 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/93287>. — Загл. с экрана

4. Николаева, И.П. Инвестиции: Учебник для бакалавров [Электронный ресурс] : учеб. — Электрон. дан. — Москва : Дашков и К, 2017. — 256 с. — Режим доступа: <https://e.lanbook.com/book/93417> . — Загл. с экрана.

Автор РПД

А.П. Пышнограй