

## **Аннотация к рабочей программе дисциплины Б1.В.16 «Управление портфельным инвестированием»**

**Объем трудоемкости:** 3 зачетные единицы

Цель дисциплины: сформировать совокупность знаний, умений и навыков в области формирования инвестиционных стратегий, финансового плана исходя из финансовых целей клиента, оценки и управления риском и эффективностью инвестиционного портфеля в условиях цифровизации экономики с учетом существующих финансово-экономических рисков.

**Задачи дисциплины:**

- изучить теоретические и методические основы управления портфелем финансовых активов и инвестиционные стратегии;
- изучить научные подходы к проведению финансово-экономических расчетов и оценке доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в портфель финансовых активов;
- овладеть умением оценки финансовой эффективности и целевых параметров инвестиционного портфеля;
- получить навыки сбора, систематизации и анализа информации для обоснования финансового плана и осуществления коммуникаций в ходе финансирования и управления портфелем активов;
- получить навыки оценки и анализа финансовых рисков инвестиционных портфелей;
- сформировать компетенции по управлению портфелем с учетом финансово-экономических рисков в условиях цифровой среды.

### **Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Управление портфельным инвестированием» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 «Дисциплины (модули)» учебного плана. В соответствии с рабочим учебным планом дисциплина изучается в 4 семестре по очной форме обучения и на 2 курсе по заочной форме обучения. Вид промежуточной аттестации: экзамен.

Дисциплина «Управление портфельным инвестированием» базируется на общеэкономических знаниях, полученных в ряде предшествующих дисциплин: «Финансирование и управление инвестиционными проектами», «Финансово-экономический анализ (продвинутый уровень)», «Финансовые рынки и институты», «Нормативно-правовое регулирование в финансовой сфере», «Корпоративные финансы в цифровой экономике», «Актуальные проблемы финансовой науки и практики».

Знание этих дисциплин поможет магистрантам глубже изучить специфику управления инвестиционными проектами для оптимизации процесса организации, планирования, финансирования и реализации инвестиционной деятельности.

Данная дисциплина поможет получить практические навыки деятельности в области принятия решений о управлении инвестиционным портфелем, проектами, финансовом консультировании. Знания, умения и навыки, полученные в процессе изучения дисциплины могут быть использованы при изучении дисциплин «Финансовое консультирование», «Финансовые технологии», при подготовке выпускной квалификационной работы (магистерской работы) и в практической деятельности.

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

Изучение данной учебной дисциплины направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций:

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
<b>ПК-2</b>	Способен консультировать клиентов по составлению финансового плана и формированию целевого инвестиционного портфеля
ИПК-2.2 Демонстрирует способность разрабатывать финансовый план и целевой инвестиционный портфель для клиента	<p>Знает инвестиционные стратегии, принципы и методы управления портфелем финансовых активов; Знает принципы соотношения риска и доходности; Знает методы анализа доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в портфель финансовых активов</p> <p>Умеет рассчитывать показатели риска и целевой эффективности инвестиционного портфеля; Умеет применять методы оценки финансовой эффективности и параметры целевого инвестиционного портфеля в соответствии с профилем клиента;</p> <p>Рассчитывает, обосновывает и составляет финансовый план и целевой портфель исходя из финансовых целей клиента Осуществляет мониторинг и оценку финансового плана, эффективности и риска инвестиционного портфеля; Организует взаимодействие с клиентом.</p>

### Содержание дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины  
Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 4 семестре (*очная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа		Внеаудит. работа	
			Л	ПЗ		ЛР
1.	Понятие и принципы формирования инвестиционного портфеля	14	2	4		8
2.	Особенности деятельности портфельного инвестора на рынке ценных бумаг	12	2	2		8
3.	Процесс управления инвестиционным портфелем и составления финансового плана	14	4	2		8
4.	Подходы к оценке эффективности и риска инвестиционного портфеля. Мониторинг инвестиционного портфеля.	17	4	4		9
5.	Инвестиционные стратегии и стили управления	12	2	2		8
6.	Подходы к оптимизации инвестиционного портфеля	12	2	2		8
	<b>ИТОГО по разделам дисциплины</b>	<b>81</b>	<b>16</b>	<b>16</b>		<b>49</b>
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	<b>0,3</b>				
	Подготовка к экзамену	<b>26,7</b>				
	<b>Общая трудоемкость по дисциплине</b>	<b>108</b>				

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 2 курсе (*заочная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудит. работа
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Понятие и принципы формирования инвестиционного портфеля	14	1	2		15
2.	Особенности деятельности портфельного инвестора на рынке ценных бумаг	12	1	2		14
3.	Процесс управления инвестиционным портфелем и составления финансового плана	14	2	2		13
4.	Подходы к оценке эффективности и риска инвестиционного портфеля. Мониторинг инвестиционного портфеля.	17	2	2		13
5.	Инвестиционные стратегии и стили управления	12	1	2		13
6.	Подходы к оптимизации инвестиционного портфеля	12	1	2		15
	<b>ИТОГО по разделам дисциплины</b>	<b>99</b>	<b>4</b>	<b>12</b>		<b>83</b>
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к экзамену	8,7				
	<b>Общая трудоемкость по дисциплине</b>	<b>108</b>				

Примечание: Л – лекции, ПЗ – практические занятия / семинары, ЛР – лабораторные занятия, СРС – самостоятельная работа студента

**Курсовые проекты или работы:** не предусмотрены

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** Экзамен

Автор РПД: к.э.н., доцент кафедры ЭАСиФ      А.П. Пышнограй