

Аннотация к рабочей программе дисциплины
Б1.В.ДЭ.01.01 «Портфельные теории и управление активами»

Объем трудоемкости: 2 зачетные единицы

Цель дисциплины: формирование у магистрантов теоретических знаний и практических навыков в сфере управления портфелем инвестиций в современных экономических условиях.

Задачи дисциплины

- формирование знаний об экономической сущности инвестиционного портфеля, а также об основных инвестиционных продуктах банковских институтов;
- формирование знаний о теоретических и методических основах формирования и управления портфелем финансовых активов и инвестиционных стратегиях;
- рассмотрение научных подходов к проведению финансово-экономических расчетов и оценке доходности, риска и эффективности инвестиционных вложений в портфель финансовых активов;
- овладение умением оценки финансовой эффективности и целевых параметров инвестиционного портфеля;
- получение навыков сбора, систематизации и анализа информации для обоснования финансового плана и осуществления коммуникаций в ходе финансирования и управления портфелем активов;
- получить навыки анализа и проведения финансовых расчетов для обоснования принимаемых управленческих решений в области управления инвестиционным портфелем, проектирования стратегий управления портфелем финансовых вложений.

Место дисциплины в структуре образовательной программы

Дисциплина «Портфельные теории и управление активами» 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: зачет.

Дисциплина «Портфельные теории и управление активами» базируется на общеэкономических знаниях, полученных в ряде предшествующих дисциплин: «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты», «Финансирование и управление инвестиционными проектами», «Актуальные проблемы финансовой науки и практики», «Финансово-экономический анализ (продвинутый уровень)», «Нормативно-правовое регулирование финансового сектора».

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
ПК-2	Способен разрабатывать стратегии развития дистанционного банковского обслуживания
ИПК-2.2 Демонстрирует способность разрабатывать аналитическое обоснование и план стратегического развития дистанционного банковского обслуживания	Знать инвестиционные стратегии, принципы и методы управления портфелем финансовых активов банковских институтов; Знать методологию формирования и управления портфелем финансовых активов; Уметь классифицировать, систематизировать информацию и проводить оценку эффективности портфеля финансовых активов; Уметь классифицировать, систематизировать информацию и анализировать финансовые показатели финансовых институтов и хозяйствующих субъектов

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
	Осуществлять анализ и оценку финансовой эффективности инвестиционных вложений; Разрабатывать стратегию управления портфелем финансовых вложений

Содержание дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины, ОФО

Общая трудоёмкость дисциплины составляет 2 зачетные единицы (72 часа).

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	4		8
3.	Методы оптимизации инвестиционного портфеля	17	2	4		9
4.	Стратегии управления инвестиционным портфелем	12	2	4		8
	ИТОГО по разделам дисциплины	71,8	8	16		47,8
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,2				
	Подготовка к экзамену					
	Общая трудоемкость по дисциплине	72				

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. Основы портфельного инвестирования : учебник для вузов / Т. В. Никитина, А. В. Репета-Турсунова, М. Фрёммель, А. В. Ядрин. — 2-е изд., испр. и доп. — Москва : Издательство Юрайт, 2020. — 195 с. — (Высшее образование). — ISBN 978-5-534-07092-7. — Текст : электронный // Образовательная платформа Юрайт [сайт]. — URL: <https://urait.ru/bcode/452191> (дата обращения: 25.08.2021).

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: к.э.н., доцент А.П. Пышнограй