

**Аннотация к рабочей программе дисциплины  
Б1.В.20 «Управление портфелем финансовых активов кредитной организации»**

**Объем трудоемкости:** 4 зачетных единиц

**Цель дисциплины:** формирование у обучающихся совокупности знаний, умений и навыков в области управления портфелем финансовых активов и рисками кредитных организаций, оценки эффективности и построения моделей оптимизации портфельных инвестиций.

**Задачи дисциплины:**

- сформировать представление об основных принципах и особенностях управления портфелем финансовых активов кредитных организаций;
- овладеть теоретическими основами управления рисками портфельных инвестиций кредитных организаций;
- сформировать знания основ организации работы кредитной организации с ценными бумагами;
- приобрести умения применять инструментарий управления портфелем финансовых активов и рисками кредитных организаций;
- приобрести умения использовать полученные знания для решения практических задач, связанных с проведением расчетов и построением моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций;
- выработать навыки оценки эффективности инвестиционного портфеля кредитных организаций;
- выработать навыки сбора и анализа информации, необходимой для проведения расчетов и построения моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций.

**Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина «Управление портфелем финансовых активов кредитной организации» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений Блока 1 "Дисциплины (модули)" учебного плана.

Дисциплина опирается на знания и навыки, приобретенные в результате изучения дисциплин: «Финансовая грамотность», «Банковское дело», «Финансовые рынки и институты», «Анализ деятельности коммерческого банка», «Инвестиционный менеджмент», «Рынок ценных бумаг и биржевое дело». Знания, полученные в ходе изучения дисциплины, применяются в процессе изучения дисциплин «Управление рисками инвестиционного проекта», «Организация деятельности казначейства банка», «Риск-менеджмент в банковской сфере», при прохождении производственной практики и написании выпускной квалификационной работы.

**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-1 Способен управлять рисками коммерческих банков</b>	
ИПК-1.11. Осуществляет расчеты и построение моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций для обеспечения финансовой безопасности	Знает принципы, методы и особенности управления рисками портфельных инвестиций кредитных организаций; Знает методические основы оценки эффективности инвестиционного портфеля кредитных организаций; Знает организационные основы работы кредитной организации с ценными бумагами
	Умеет применять инструментарий управления рисками портфельных инвестиций кредитных организаций;

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Результаты обучения по дисциплине
	<p>Умеет анализировать эффективность инвестиционного портфеля кредитных организаций;</p> <p>Умеет использовать полученные знания для решения практических задач, связанных с проведением расчетов и построением моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций</p> <p>Осуществляет трудовые действия по управлению рисками портфельных инвестиций кредитных организаций;</p> <p>Осуществляет оценку эффективности инвестиционного портфеля кредитных организаций;</p> <p>Осуществляет трудовые действия по сбору и анализу информации для проведения расчетов и построения моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций</p>
<b>ПК-4 Способен управлять ресурсами коммерческих банков</b>	
ИПК-4.6. Осуществляет расчеты и построение моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций для обеспечения финансовой безопасности	<p>Знает принципы и особенности управления портфелем финансовых активов кредитных организаций;</p> <p>Знает методические основы оценки эффективности инвестиционного портфеля кредитных организаций;</p> <p>Знает организационные основы работы кредитной организации с ценными бумагами</p> <p>Умеет применять инструментарий управления портфелем финансовых активов кредитных организаций;</p> <p>Умеет анализировать эффективность инвестиционного портфеля кредитных организаций;</p> <p>Умеет использовать полученные знания для решения практических задач, связанных с проведением расчетов и построением моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций</p> <p>Осуществляет трудовые действия по управлению портфелем финансовых активов кредитных организаций;</p> <p>Осуществляет оценку эффективности инвестиционного портфеля кредитных организаций;</p> <p>Осуществляет трудовые действия по сбору и анализу информации для проведения расчетов и построения моделей оптимизации портфельных инвестиций кредитных организаций</p>

Результаты обучения по дисциплине достигаются в рамках осуществления всех видов контактной и самостоятельной работы обучающихся в соответствии с утвержденным учебным планом.

Индикаторы достижения компетенций считаются сформированными при достижении соответствующих им результатов обучения.

#### **Содержание дисциплины:**

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины.  
 Разделы (темы) дисциплины, изучаемые в 9 семестре (*очная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа СРС
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Теоретические основы формирования портфеля финансовых активов кредитной организации	20	6	2		12
2.	Организация деятельности кредитной организации на рынке ценных бумаг и ее регулирование	22	6	4		12
3.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем финансовых активов кредитной организации	20	6	2		12
4.	Оценка эффективности управления портфелем финансовых активов кредитной организации	24	8	4		12
5.	Особенности управления валютным портфелем кредитной организации	24	8	4		12
<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>		110	34	16	-	60
Контроль самостоятельной работы (КСР)		7				
Промежуточная аттестация (ИКР)		0,3				
Подготовка к экзамену		26,7				
Общая трудоемкость по дисциплине		144				

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

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 5 курсе (*заочная форма обучения*)

№	Наименование разделов (тем)	Количество часов				
		Всего	Аудиторная работа			Внеаудиторная работа СРС
			Л	ПЗ	ЛР	
1.	Теоретические основы формирования портфеля финансовых активов кредитной организации	27	1	-		26
2.	Организация деятельности кредитной организации на рынке ценных бумаг и ее регулирование	26	1	-		25
3.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем финансовых активов кредитной организации	27	2	1		24
4.	Оценка эффективности управления портфелем финансовых активов кредитной организации	28	2	2		24
5.	Особенности управления валютным портфелем кредитной организации	27	2	1		24
<i>ИТОГО по разделам дисциплины</i>		135	8	4	-	123
Контроль самостоятельной работы (КСР)		-				
Промежуточная аттестация (ИКР)		0,3				
Подготовка к экзамену		8,7				
Общая трудоемкость по дисциплине		144				

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

**Курсовые работы:** *не предусмотрены*

**Форма проведения аттестации по дисциплине:** *экзамен*

Автор

К.э.н., ст. преподаватель кафедры ЭАСиФ

Смолякова Н.В.