

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
ПК-2 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	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
	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;
	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.

Содержание дисциплины:

Распределение видов учебной работы и их трудоемкости по разделам дисциплины:
Общая трудоёмкость дисциплины составляет 3 зачетные единицы (108 часов).

Разделы (темы) дисциплины, изучаемые на 2 курсе (*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
	ИТОГО по разделам дисциплины	81	16	16		49
	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к экзамену	26,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	108				

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
7.	ИТОГО по разделам дисциплины	99	4	12		83
8.	Контроль самостоятельной работы (КСР)					
	Промежуточная аттестация (ИКР)	0,3				
	Подготовка к экзамену	8,7				
	Общая трудоемкость по дисциплине	108				

Курсовые проекты или работы: не предусмотрены

Форма проведения аттестации по дисциплине: Экзамен

Автор РПД: Зотов Д.А.