

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Антипова Наталья Викторовна
Должность: и.о. директора филиала
Дата подписания: 20.02.2024 18:49:52
Уникальный программный ключ:
fae5412acb1bf810dc69e6bc004ac45622b84b3a

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации
Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования

«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»

Улан-Баторский филиал РЭУ им. Г.В. Плеханова



АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.19 УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

Направление подготовки	38.03.01 Экономика
Направленность (профиль) программы	Финансы и кредит
Уровень высшего образования	Бакалавриат

1. Цель и задачи дисциплины:

Целью дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» является усвоение теоретических и практических основ формирования инвестиционного портфеля и управления им с целью достижения оптимальных с точки зрения инвестора соотношений доходности и риска, связанных с инвестиционными решениями, с использованием современных оптимизационных методов и подходов.

Учебные задачи дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» состоят в:

- 1) изучении теоретических основ в области портфельного инвестирования;
- 2) изучении основных целей портфельного инвестора;
- 3) приобретении студентами практических навыков по формированию инвестиционных портфелей с приемлемым для инвестора соотношением риск/доходность;
- 4) формировании практических навыков по прогнозированию ожидаемого риска и доходности инвестиционного портфеля, осуществлению операций хеджирования по страхованию ценовых рисков, умению рассчитать эффективность сформированного портфеля.

2. Содержание дисциплины:

№ п/п	Наименование разделов / тем дисциплины
1.	Основные понятия
2.	Определение показателей риска и доходности инвестиционного портфеля
3.	Этапы управления инвестиционным портфелем.
4.	Оптимизация инвестиционного портфеля
5.	Использование фундаментального анализа при управлении портфелем.
6.	Использование технического анализа при управлении портфелем.
Трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е. / 144 часа.	

Форма контроля – экзамен

Разработчик:

РЭУ имени Г.В. Плеханова
кафедра «Финансовые рынки»

доцент

С.Н. Диго