

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**



Одобрено  
на заседании Совета Улан-Баторского  
филиала РЭУ им. Г.В. Плеханова  
Протокол № 11 от 15.06. 2021 г.  
Председатель совета  
Н.В.Антипова

**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.
<b>Трудоемкость дисциплины составляет 4 з.е. / 144 часа.</b>	

**Форма контроля – экзамен**

**Разработчик:**

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

доцент

С.Н. Диго