


Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Антипова Наталья Викторовна
Должность: и.о. директора филиала
Дата подписания: 06.03.2024 11:22:00
Уникальный программный ключ:
fae5412acb1bf810dc69e6bc004ac45622b84b3a

**МИНИСТЕРСТВО НАУКИ И ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ**

**федеральное государственное бюджетное общеобразовательное
учреждение высшего образования
«Российский экономический университет имени Г.В. Плеханова»**

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



Одобрено
На заседании Совета филиала
протокол № 8 от «30. мая» 2019 г.
Председатель совета
 Н.В. Антипова

АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Б1.В.ДВ.03.02.02 УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

Направление подготовки: 38.03.01 Экономика

Направленность (профиль) программы – Финансы и кредит

Уровень высшего образования: Бакалавриат

Программа подготовки: Академический бакалавриат

(Для набора 2020 г.)

Улан-Батор – 2019 г.

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

Учебные задачи дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» состоят:

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

Дисциплина основывается на знании следующих дисциплин: Теория вероятностей и математическая статистика, Финансовые вычисления, Рынок ценных бумаг.

Изучение дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» необходимо для успешного прохождения всех видов практик и написания выпускной квалификационной работы.

Требования к результатам освоения содержания дисциплины

В результате освоения дисциплины студент должен обладать следующими компетенциями:

ОПК-4 – способностью находить организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности и готовностью нести за них ответственность

В результате освоения компетенции ОПК-4 студент должен:

1. **знать:** действующую нормативно-правовую базу в сфере профессиональной деятельности.
2. **уметь:** анализировать данные и применять полученные результаты в процессе финансовой деятельности, обосновывать полученные выводы
3. **владеть:** способностью нести ответственность за принятые решения по управлению инвестиционным процессом

ПК-8 – способностью использовать для решения аналитических и исследовательских задач современные технические средства и информационные технологии

В результате освоения компетенции ПК-8 студент должен:

1. **знать:** способы и средства получения, хранения переработки информации в сфере инвестиций;
2. **уметь:** использовать компьютер как средство управления информацией;
3. **владеть:** методами количественного анализа и моделирования, навыками проведения анализа сложных экономических систем и интерпретации результатов с использованием информационных технологий при формировании инвестиционного портфеля

ПК-20 – способностью вести работу по налоговому планированию в составе бюджетов бюджетной системы Российской Федерации

В результате освоения компетенции ПК-20 студент должен:

1. **знать:** основы работы по налоговому планированию в инвестиционной деятельности;
2. **уметь:** вести работу по налоговому планированию в бюджетах организации.

3. **владеть:** навыками налогового планирования в составе бюджетов организаций и бюджетной системы Российской Федерации, а также исчисления и выплаты налогов по инвестиционным операциям

ПК-22 – способностью применять нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля

В результате освоения компетенции ПК- 22 студент должен:

1. **знать:** нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля

2. **уметь:** использовать нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля инвестиционной деятельности.

3. **владеть:** навыками применения норм, регулирующих бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля инвестиционной деятельности

ПК-25 – способностью оценивать кредитоспособность клиентов, осуществлять и оформлять выдачу и сопровождение кредитов, проводить операции на рынке межбанковских кредитов, формировать и регулировать целевые резервы

В результате освоения компетенции ПК- 25 студент должен:

1. **знать:** содержание и порядок проведения кредитных и инвестиционных операций, требования к данным операциям, порядок формирования резервов на возможные потери;

2. **уметь:** оформлять кредитные операции,

3. **владеть:** навыками формирования и регулирования целевых резервов с целью защиты от рисков инвестиционного портфеля

Содержание дисциплины

Тема 1	Основные понятия
Тема 2	Определение показателей риска и доходности инвестиционного портфеля
Тема 3	Этапы управления инвестиционным портфелем.
Тема 4	Оптимизация инвестиционного портфеля
Тема 5	Использование фундаментального анализа при управлении портфелем.
Тема 6	Использование технического анализа при управлении портфелем.
итого	144 ч

Формы контроля - экзамен