

Б1.В.ДВ.03.01.05 Управление инвестиционным портфелем

Цель дисциплины

освоение теоретических и практических подходов формирования инвестиционного портфеля и управления им с целью достижения оптимального с точки зрения инвестора соотношения доходность-риск на основе использования современных оптимизационных методов и подходов.

Учебные задачи дисциплины

- приобретение студентами теоретических знаний в области портфельного инвестирования;
- изучение основных целей портфельного инвестора;
- приобретение студентами практических навыков по формированию инвестиционных портфелей с приемлемым для инвестора соотношением риск/доходность;
- формирование практических навыков по прогнозированию ожидаемого риска и доходности инвестиционного портфеля, осуществлению операций хеджирования по страхованию ценовых рисков, умению рассчитать эффективность сформированного портфеля.

Место дисциплины в структуре ООП

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» является дисциплиной по выбору профессионального цикла ООП (Б1.В.ДВ.03.01.05).

Дисциплина основывается на знании следующих дисциплин: «Экономика фирмы» (Б1.Б.18), «Планирование и прогнозирование в экономике» (Б1.В.03), «Финансовые вычисления» (Б1.В.06), «Финансовый менеджмент» (Б1.В.12), «Рынок ценных бумаг» (Б1.В.13).

Для успешного освоения дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» студент должен:

Знать:

- портфельную теорию, ее составляющие и основные модели построения оптимального инвестиционного портфеля.

Уметь:

- разрабатывать инвестиционную стратегию и тактику, а также осуществлять мониторинг инвестиционного портфеля;
- проводить эффективное размещение временно свободных денежных средств на рынке ценных бумаг при приемлемом соотношении риск/доходность;
- разрабатывать и реализовывать программы минимизации рисков основных операций и бизнес-проектов посредством операций с производными финансовыми инструментами;

Владеть:

- инструментарием портфельной теории и портфельного моделирования;
- методиками анализа финансового рынка и формирования диверсифицированного портфеля ценных бумаг;
- навыками инвестиционных расчетов.

Изучение дисциплины необходимо для дальнейшего освоения дисциплины: «Финансовый риск-менеджмент» (Б1.В.ДВ.05.02.02), «Оценка кредитоспособности заемщика и группы компаний» (Б1.В.ДВ.03.02.05).

Требования к результатам освоения содержания дисциплины

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы компетенции:

– умение собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-1);

– умение осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения поставленных экономических задач (ПК-4).

В результате освоения компетенций студент должен:

Знать:

- основные способы сбора, анализа и обработки данных, необходимых для решения поставленных экономических задач (ПК-4);

Уметь:

- выбрать инструментальные средства для обработки экономических данных в соответствии с поставленной задачей, проанализировать результаты расчетов и обосновать полученные выводы (ПК-1);

Владеть:

- навыками сбора и анализа исходных данных, необходимых для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов (ПК-1).

Содержание дисциплины

№ п/п	Наименование раздела, темы 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

Форма контроля: экзамен