

Б1.В.ДВ.3 «УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ»

Цель дисциплины: овладение ключевыми теоретическими и практическими знаниями по вопросам инвестирования средств, выбора инвестиционных проектов, определения оптимального состава источников финансирования, оценки эффективности вложений в различные инвестиционные инструменты, управления инвестиционным портфелем и некоторыми другими.

Задачи дисциплины:

- ознакомить студентов с особенностями управления инвестиционным портфелем;
- обучить студентов методическим основам оценки финансовых инвестиций;
- изучить факторы, влияющих на ценообразование финансовых инвестиций;
- выработать у студентов практические навыки построения инвестиционных стратегий на основе торговли ценными бумагами.

Место дисциплины в структуре ОПОП:

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» относится к вариативной части учебного плана. К дисциплинам, знания которых используются при изучении «Управление инвестиционным портфелем», можно отнести следующие: «Актуальные проблемы финансов», «Финансовый риск-менеджмент».

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

Знать:

- экономическое содержание инвестиционной стратегии и стратегической инвестиционной деятельности (ПК-17);
- основные подходы к формированию инвестиционной стратегии (ПК-5);
- классификацию методов и методик разработки инвестиционной стратегии (ПК-22);
- важнейшие понятия и подходы к оценке инвестиционных проектов (ПК-6);
- критерии отбора проектов в портфель и выбора конкретных ценных бумаг (ПК-17);
- зарубежный и отечественный опыт в области привлечения инвестиций (ПК-18).

Уметь:

- проводить практические расчеты по обоснованию инвестиционных предложений (ПК-21);
- оценивать уровень влияния управленческих инвестиционных решений на финансово-хозяйственную деятельность организации (ПК-18);
- грамотно формулировать стратегические инвестиционные цели и инвестиционные ресурсы предприятия (ПК-5);
- формировать оптимальную структуру источников финансирования деятельности предприятия (ПК-17);
- анализировать статистические материалы по финансовому положению предприятия, осуществляющего проект (ПК-22);
- теоретически обобщать эмпирические материалы (ПК-5);
- вырабатывать практические рекомендации по управлению портфелем реальных проектов и портфелем ценных бумаг предприятия (ПК-22);
- планировать, прогнозировать статьи бюджетов, составлять таблицы денежных потоков (ПК-17);
- грамотно оценивать преимущества и недостатки, которые связаны с притоком иностранных и отечественных инвестиций в экономику предприятия (ПК-22);
- составлять расчеты выплат и графиков погашения, планы финансирования (ПК-5).

Владеть:

- целями, задачами планирования инвестиционной деятельности в системе управления деятельностью хозяйствующих субъектов (ПК-6);
- основными понятиями, связанных с управлением инвестициями в практике российских компаний (ПК-17);
- целями и функциями инвестиционного процесса и инвестиционной деятельности хозяйствующего субъекта (ПК-5);
- закономерностями инвестиционных процессов (ПК-6).

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» является основой для изучения последующих дисциплин, таких как: «Стратегия и тактика ценообразования».

Требования к результатам освоения содержания дисциплины

В результате освоения дисциплины должны быть сформированы следующие компетенции:

НАУЧНО-ИССЛЕДОВАТЕЛЬСКАЯ ДЕЯТЕЛЬНОСТЬ:

ПК – 2 - способность анализировать и использовать различные источники информации для проведения финансово-экономических расчетов.

В результате освоения компетенции ПК - 2 студент должен:

Знать:

- экономическое содержание инвестиционной стратегии и стратегической инвестиционной деятельности;
- основные подходы к формированию инвестиционной стратегии.

Уметь:

- проводить практические расчеты по обоснованию инвестиционных предложений;
- оценивать уровень влияния управленческих инвестиционных решений на финансово-хозяйственную деятельность организации;
- грамотно формулировать стратегические инвестиционные цели и инвестиционные ресурсы предприятия;
- грамотно оценивать преимущества и недостатки, которые связаны с притоком иностранных и отечественных инвестиций в экономику предприятия;
- составлять расчеты выплат и графиков погашения, планы финансирования.

Владеть:

- целями, задачами планирования инвестиционной деятельности в системе управления деятельностью хозяйствующих субъектов;
- основными понятиями, связанных с управлением инвестициями в практике российских компаний;
- закономерностями инвестиционных процессов.

ПК – 4 - способность провести анализ и дать оценку существующих финансово-экономических рисков, составить и обосновать прогноз динамики основных финансово-экономических показателей на микро-, макро- мезоуровне.

В результате освоения компетенции ПК - 4 студент должен:

Знать:

- важнейшие понятия и подходы к оценке инвестиционных проектов;
- критерии отбора проектов в портфель и выбора конкретных ценных бумаг;
- зарубежный и отечественный опыт в области привлечения инвестиций.

Уметь:

- анализировать статистические материалы по финансовому положению предприятия, осуществляющего проект;
- теоретически обобщать эмпирические материалы;
- вырабатывать практические рекомендации по управлению портфелем реальных проектов и портфелем ценных бумаг предприятия.
- планировать, прогнозировать статьи бюджетов, составлять таблицы денежных потоков.

Владеть:

- целями, задачами планирования инвестиционной деятельности в системе управления деятельностью хозяйствующих субъектов;
- закономерностями инвестиционных процессов.

ПК – 23 – способность выявлять и проводить исследование финансово - экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов для разработки системы управления рисками.

В результате освоения компетенции ПК - 23 студент должен:

Знать:

- основные подходы к формированию инвестиционной стратегии;
- классификацию методов и методик разработки инвестиционной стратегии;
- зарубежный и отечественный опыт в области привлечения инвестиций.

Уметь:

- оценивать уровень влияния управленческих инвестиционных решений на финансово-хозяйственную деятельность организации;
- грамотно формулировать стратегические инвестиционные цели и инвестиционные ресурсы предприятия;
- вырабатывать практические рекомендации по управлению портфелем реальных проектов и портфелем ценных бумаг предприятия.
- планировать, прогнозировать статьи бюджетов, составлять таблицы денежных потоков.

Владеть:

- основными понятиями, связанных с управлением инвестициями в практике российских компаний;
- закономерностями инвестиционных процессов.

ПК – 24 – способность проводить исследование проблем финансовой устойчивости организаций, в том числе финансово-кредитных, для разработки эффективных методов ее обеспечения с учетом фактора неопределенности.

В результате освоения компетенции ПК - 24 студент должен:

Знать:

- важнейшие понятия и подходы к оценке инвестиционных проектов;
- критерии отбора проектов в портфель и выбора конкретных ценных бумаг;
- зарубежный и отечественный опыт в области привлечения инвестиций.

Уметь:

- грамотно формулировать стратегические инвестиционные цели и инвестиционные ресурсы предприятия;
- формировать оптимальную структуру источников финансирования деятельности предприятия;
- вырабатывать практические рекомендации по управлению портфелем реальных проектов и портфелем ценных бумаг предприятия.
- грамотно оценивать преимущества и недостатки, которые связаны с притоком иностранных и отечественных инвестиций в экономику предприятия.

Владеть:

- целями и функциями инвестиционного процесса и инвестиционной деятельности хозяйствующего субъекта;
- закономерностями инвестиционных процессов.

ПК – 25 – способность интерпретировать результаты финансово-экономических исследований с целью разработки финансовых аспектов перспективных направлений инновационного развития организаций, в том числе финансово-кредитных.

В результате освоения компетенции ПК - 25 студент должен:

Знать:

- основные подходы к формированию инвестиционной стратегии;
- классификацию методов и методик разработки инвестиционной стратегии;
- важнейшие понятия и подходы к оценке инвестиционных проектов.

Уметь:

- формировать оптимальную структуру источников финансирования деятельности предприятия;
- вырабатывать практические рекомендации по управлению портфелем реальных проектов и портфелем ценных бумаг предприятия.
- планировать, прогнозировать статьи бюджетов, составлять таблицы денежных потоков;
- составлять расчеты выплат и графиков погашения, планы финансирования.

Владеть:

- целями, задачами планирования инвестиционной деятельности в системе управления деятельностью хозяйствующих субъектов;
- целями и функциями инвестиционного процесса и инвестиционной деятельности хозяйствующего субъекта.

Содержание дисциплины:

| № п/п | Наименование раздела дисциплины (темы) |
|-------|--|
| 1 | Тема 1. Инвестиции и их классификация |
| 2 | Тема 2. Теоретические основы разработки инвестиционной стратегии |
| 3 | Тема 3. Анализ финансового состояния предприятия при формировании инвестиционной стратегии |
| 4 | Тема 4. Финансовый анализ эффективности инвестиционных проектов как фактор разработки инвестиционной стратегии |
| 5 | Тема 5. Измерение инвестиционного дохода и риска |
| 6 | Тема 6. Оценка инвестиционных инструментов |
| 7 | Тема 7. Инвестиционный портфель и управление им |

Форма контроля – ЗАЧЕТ С ОЦЕНКОЙ