

АННОТАЦИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Наименование дисциплины (модуля)

Управление инвестиционным портфелем

Наименование ОПОП ВО

38.05.01 Экономическая безопасность. Экономико-правовое обеспечение экономической безопасности

Цели и задачи дисциплины (модуля)

Целью изучения дисциплины является формирование у бакалавров прочных теоретических знаний и практических навыков в области вложений денежных средств в различные ценные бумаги и реальные инвестиции и управление ими.

В процессе изучения курса решаются следующие задачи:

- изучение сущности, общеэкономического значения и особенностей инвестирования в ценные бумаги и реальные инвестиции;
- определение эффективности от вложения в ценные бумаги и реальные инвестиции;
- изучение современных концепций портфельного анализа, теории оптимизации инвестиционного портфеля;
- определение риска и доходности инвестиционного портфеля;
- применение на практике методов и принципов формирования инвестиционного портфеля;
- определение степени реструктуризации портфеля из ценных бумаг.

Результаты освоения дисциплины (модуля)

Планируемыми результатами обучения по дисциплине являются знания, умения, навыки, соотнесенные с компетенциями, которые формирует дисциплина, и обеспечивающие достижение планируемых результатов по образовательной программе в целом. Перечень компетенций, формируемых в результате изучения дисциплины, приведен в таблице 1.

Таблица 1 – Компетенции обучающегося, формируемые в результате освоения дисциплины (модуля)

Название ОПОП ВО, сокращенное	Код компетенции	Формулировка компетенции	Планируемые результаты обучения	
38.05.01 «Экономическая безопасность» (ЭБ)	ПК-32	способность проводить анализ возможных экономических рисков и давать им оценку, составлять и обосновывать прогнозы динамики развития основных угроз экономической безопасности	Знания:	основных характеристик инвестиционного портфеля
			Умения:	анализировать и оценивать экономические риски для обоснования решений по управлению инвестиционным портфелем хозяйствующего субъекта
			Навыки:	анализа инвестиционного портфеля хозяйствующего субъекта
	ПК-43	способность принимать оптимальные управленческие решения с учетом критериев социально-экономической эффективности, рисков	Знания:	методов управления инвестиционным портфелем
			Навыки:	обоснования решений по управлению инвестиционным портфелем

		и возможностей использования имеющихся ресурсов	Навыки:	формулировать варианты решений по управлению инвестиционным портфелем и инвестиционными рисками
--	--	---	---------	---

Основные тематические разделы дисциплины (модуля)

- 1) Основные понятия портфельного инвестирования.
- 2) Основные стратегии управления инвестиционным портфелем
- 3) Формирование оптимального портфеля инвестиций.
- 4) Портфель ценных бумаг и модель оценки капитальных активов.
- 5) Портфель реальных инвестиций (проектов) и их оценка эффективности.
- 6) Экономические риски и управления ими в портфельном инвестировании
- 7) Основные риски портфельного инвестирования и практика управления портфелем.
- 8) Страхование риска в портфельном инвестировании.
- 9) Основы хеджирования рисков портфельного инвестирования.

Трудоемкость дисциплины (модуля) и виды учебной работы

Объем дисциплины (модуля) в зачетных единицах с указанием количества академических часов, выделенных на контактную работу с обучающимися (по видам учебных занятий) и на самостоятельную работу по всем формам обучения, приведен в таблице 2.

Таблица 2 – Трудоёмкость дисциплины

Название ОПОП ВО	Форма обуче- ния	Часть УП	Семестр (ОФО) или курс (ЗФО, ОЗФО)	Трудо- емкость	Объем контактной работы (час)						СРС	Форма аттес- тации
				(З.Е.)	Всего	Аудиторная			Внеауди- торная			
						лек.	прак.	лаб.	ПА	КСР		
38.05.01 Экономическая безопасность	ОФО	С.1.ДВ.В	7	5	55	18	36	0	1	0	125	Э

Составители(ль)

Лебединская Ю.С., кандидат экономических наук, доцент, Кафедра экономики и управления, Yuliya.Lebedinskaya@vvsu.ru