

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.14.03 Управление инвестиционным портфелем
наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль)

38.03.02 Менеджмент

Форма обучения

очная

Год набора

2023

Красноярск 2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили _____

Кошкин А.Н.

должность, инициалы, фамилия

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» является одной из дисциплин по выбору вариативной части программы подготовки бакалавров по направлению 38.03.02 Менеджмент.

Предметом изучения является практика и проблемы управления портфелем ценных бумаг.

Цель изучения дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» - формирование у бакалавров теоретических знаний и практических навыков в области управления финансовым портфелем для принятия грамотных инвестиционных решений.

1.2 Задачи изучения дисциплины

Основными задачами изучения дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» являются:

- формирование знаний о портфельном инвестировании;
- освоение основных приемов эффективного управления финансовым портфелем.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
ПК-8: Способность принимать обоснованные решения по соответствию программ и проектов планам стратегического развития организации и интересам заинтересованных сторон и планировать процесс их реализации	
ПК-8.1: Знать основы макро- и микроэкономики, финансовой математики, теории вероятности и математической статистики, оценки рисков, стратегического менеджмента, процессы управления программами и проектами	
ПК-8.2: Уметь анализировать источники финансирования проектов и программ, оценивать их финансовые потоки и обязательные платежи, планировать управление их содержанием, эффективностью и оценкой рисков	

ПК-8.3: Владеть инструментами разработки	
алгоритмов, моделей, схем финансирования проектов и программ, выявления и оценки рисков, экономическими методами прогнозирования развития рынков на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу, процессами разработки мероприятий по управлению рисками проектов и программ, подготовки управленческой документации	

1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	е
		1
Контактная работа с преподавателем:	1,5 (54)	
занятия лекционного типа	0,5 (18)	
практические занятия	1 (36)	
Самостоятельная работа обучающихся:	1,5 (54)	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	
Промежуточная аттестация (Экзамен)	1 (36)	

3 Содержание дисциплины (модуля)

3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Контактная работа, ак. час.							
		Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС		
1. Методологические основы порт-фельного инвестирования									
1.		3							
2.				6					
3.							36		
2. Методы и модели формирования финансового портфеля									
1.		5							
2.				10					
3.							18		
3. Инвестиционные стратегии и управление финансовым портфелем									
1.		4							
2.				8					
4. Методы портфельного анализа									
1.		3							
2.				6					
5. Оценка эффективности управления финансовым портфелем									

1.	3							
2.			6					
Bcero	18		36				54	

4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1 Печатные и электронные издания:

1. Шапкин А. С. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг (Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К").
2. Шапкин А. С., Шапкин В. А. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций (Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К").
3. Соколова О. В. Финансы и кредит: Учебник (Москва: Издательство "Магистр").

4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):

1. Для изучения настоящей дисциплины обучающимся необходимо наличие доступа к информационно-телекоммуникационной сети «Интернет».
2. Программные продукты, используемые в учебном процессе:
3. - Microsoft Office Professional Plus 2007;
4. - Microsoft Windows 7,8,10;
5. - Microsoft Visio 2007.

4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

1. Справочная правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс] - Режим доступа: <http://www.consultant.ru>.
2. Информационно-правовой портал «Гарант» [Электронный ресурс] - Режим доступа: <http://www.garant.ru>.
- 3.

5 Фонд оценочных средств

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

6 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Для организации образовательного процесса используются:

- лекционные аудитории с мультимедийным оборудованием, включая проекционную и аудиотехнику;
- мультимедийные аудитории для практических занятий, оснащенные моделируемой мебелью, мультимедийным проектором;
- презентационные комплексы Smart Board, Inter Write, установленные стационарно во всех лабораторных аудиториях;

- компьютерные классы с выделенным выходом в Интернет на 15-20 рабочих мест.

Освоение дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья, в зависимости от нозологий, осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.