

Документ подписан простой электронной подписью

Информационно-образовательное учреждение высшего образования
Негосударственное аккредитованное не коммерческое частное образовательное учреждение высшего образования

ФИО: Агабекян Раиса Левоновна

образования

Должность: ректор «Академия маркетинга и социально-информационных технологий – ИМСИТ»

Дата подписания: 30.05.2023 16:33:40

(г. Краснодар)

Уникальный программный ключ:

(НАН ЧОУ ВО Академия ИМСИТ)

4237c7ccb9b9e111bbaf1f4fcd9201d015c4dbaa123ff774747307b9b9fbcbe

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе,

доцент Севрюгина Н.И.

17 апреля 2023

Портфельные теории и управление активами

Анотация к рабочей программе дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Кафедра бизнес-процессов и экономической безопасности**

Учебный план 38.04.08 Финансы и кредит

Квалификация **магистр**

Форма обучения **очная**

Программу составил(и): дэн, Профессор, Бондаренко Ирина Алексеевна

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	1 (1.1)		Итого	
	12 5/6			
Неделя				
Вид занятий	УП	РП	УП	РП
Лекции	24	24	24	24
Практические	24	24	24	24
Контактная работа на аттестации	0,2	0,2	0,2	0,2
В том числе инт.	14	14	14	14
В том числе в форме практ.подготовки	2	2	2	2
Итого ауд.	48	48	48	48
Контактная работа	48,2	48,2	48,2	48,2
Сам. работа	59,8	59,8	59,8	59,8
Итого	108	108	108	108

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	«Портфельные теории и управление активами» является формирование компетенций обучающихся по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит. Дисциплина нацелена на совершенствование и дальнейшее развитие знаний и умений по формированию у студентов представлений о теоретических основах портфельной теории, ценообразовании активов и управлении портфелем, методах применения этих теорий, а также навыках и подходах для реализации этих идей.
-----	---

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:		Б1.В
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:	
2.1.1	Методология научного исследования экономических систем	
2.1.2	Экономика развития	
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:	
2.2.1	Корпоративная финансовая политика	
2.2.2	Управление инвестициями и инновациями	

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-3: Способность использовать новые финансовые инструменты для решения конкретных прикладных задач, связанных с проблемами финансовых рынков и использования финансовых инструментов корпорациями

ПК-3.1: Составляет и согласовывает инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту

Знать:

Знает как составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту

Уметь:

Умеет составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту

Владеть:

Владеет составлением и согласованием инвестиционного портфеля клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту

ПК-3.2: Выявляет качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Знать:

Знает как выявлять качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Уметь:

Умеет выявлять качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

Владеть:

Владеет выявлением качественных и количественных свойств рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах

ПК-3.3: Проводит мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности

Знать:

Знает как проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности

Уметь:

Умеет проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности

Владеть:

Владеет проведением мониторинга качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности

ПК-3.4: Привлекает к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
Знать:
Знает как привлечь к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
Уметь:
Умеет привлечь к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
Владеть:
Владеет привлечением к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
ПК-3.5: Анализирует финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
Знать:
Знает как анализировать финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
Уметь:
Умеет анализировать финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
Владеть:
Владеет анализом финансового положения клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
ПК-3.6: Подбирает классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
Знать:
Знает как подобрать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
Уметь:
Умеет подобрать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
Владеть:
Владеет подбором классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
ПК-3.7: Проводит стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
Знать:
Знает как проводить стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
Уметь:
Умеет проводить стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
Владеть:
Владеет проведением стресс-тестов и сценарного анализа, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
ПК-3.8: Формирует финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
Знать:
Знает как формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
Уметь:
Умеет формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
Владеть:
Владеет формированием финансового плана и критериев мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
ПК-3.9: Анализирует, пересматривает (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента

Знать:
Знает как анализировать, пересматривать (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента
Уметь:
Умеет анализировать, пересматривать (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента
Владеть:
Владеет анализом, пересматривает (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента

ПК-3.10: Составляет прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)

Знать:
Знает как составлять прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)
Уметь:
Умеет составлять прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)
Владеть:
Владеет составлением прогноза денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
	Знает как составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту
	Знает как выявлять качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах
	Знает как проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности
	Знает как привлечь к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
	Знает как анализировать финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
	Знает как подобрать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
	Знает как проводить стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
	Знает как формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
	Знает как анализировать, пересматривать (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента
	Знает как составлять прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)
3.2	Уметь:
	Умеет составлять и согласовывать инвестиционный портфель клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту
	Умеет выявлять качественные и количественные свойства рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах
	Умеет проводить мониторинг качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности
	Умеет привлечь к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков
	Умеет анализировать финансовое положение клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям
	Умеет подобрать классы активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента
	Умеет проводить стресс-тесты и сценарный анализ, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента
	Умеет формировать финансовый план и критерии мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации
	Умеет анализировать, пересматривать (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента

Умеет составлять прогноз денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)	
3.3	Владеть:
Владеет составлением и согласованием инвестиционного портфеля клиента, определяет и согласовывает правила информирования клиента и критерии взаимодействия с клиентом; презентует согласованные финансовые решения клиенту	
Владеет выявлением качественных и количественных свойств рисков; составляет перечень рекомендаций по управлению инвестиционным риском в предполагаемых к использованию финансовых продуктах	
Владеет проведением мониторинга качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов) в контексте расчета величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей; размера инвестиций; целевой доходности	
Владеет привлечением к решению задач финансового планирования независимых внешних консультантов и экспертов в области финансовых рынков	
Владеет анализом финансового положения клиента на предмет выявления несоответствия текущего финансового состояния клиента его финансовым целям	
Владеет подбором классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента	
Владеет проведением стресс-тестов и сценарного анализа, по результатам которого моделирует целевой портфель клиента	
Владеет формированием финансового плана и критериев мониторинга его выполнения, определяете критерии оценки эффективности финансового плана и качества инвестиционного портфеля клиента, разрабатывает программу его оптимизации	
Владеет анализом, пересматривает (ребалансирует) состав активов, изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля клиента	
Владеет составлением прогноза денежного потока, с детальным анализом использования заемных средств (кредитные продукты)	