

Документ подписан простой электронной подписью

Информация о владельце: государственное аккредитованное не коммерческое частное образовательное учреждение высшего

ФИО: Агабекян Раиса Левоновна образования

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

Дата подписания: 19.06.2024 18:32:20 (г. Краснодар)

Уникальный программный ключ: (НАН ЧОУ ВО Академия ИМСИТ)

4237c7ccb9b9e111bbaf1f4fcd9201d015c4dbaa123ff774747307b9b9fbcbe

УТВЕРЖДАЮ

Проректор по учебной работе,
доцент Севрюгина Н.И.

25 декабря 2023 г

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 **заочная**

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

Распределение часов дисциплины по курсам

Курс	1		Итого	
	уп	рп		
Вид занятий				
Лекции	6	6	6	6
Практические	6	6	6	6
Контактная работа на аттестации (в период экз. сессий)	0,2	0,2	0,2	0,2
В том числе инт.	6	6	6	6
В том числе в форме практ.подготовки	2	2	2	2
Итого ауд.	12	12	12	12
Контактная работа	12,2	12,2	12,2	12,2
Сам. работа	92	92	92	92
Часы на контроль	3,8	3,8	3,8	3,8
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 разработать и обосновать финансово – экономические показатели, характеризующие деятельность коммерческих и некоммерческих организаций различных организационно – правовых форм, включая финансово – кредитных органов государственной власти и местного самоуправления

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)	