

## АННОТАЦИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ

**Автор:** Витренко Л.А., доцент

**Наименование дисциплины:** Б1.В.03 Управление портфелем финансовых активов

**Цель освоения дисциплины:** сформировать у обучающихся систему теоретических знаний принятия управленческих финансовых решений, создающих основу для подготовки высококвалифицированного магистра экономики, способного научно обоснованно решать практические задачи управления денежным оборотом и финансами организации.

### 1. Требования к результатам освоения дисциплины:

Индекс и содержание компетенции	Знания	Умения	Навыки и (или) опыт деятельности
<b>ПК – 7</b> способностью осуществлять самостоятельно или руководить подготовкой заданий и разработкой финансовых аспектов проектных решений и соответствующих нормативных и методических документов для реализации подготовленных проектов.	-1 этап: принципы управления движением денежных потоков, формированием и использованием финансовых ресурсов; 2 этап: основы разработки планов и программ проведения исследований в области финансов и кредита;	1 этап: разрабатывать методы и инструменты для проведения финансово-экономических исследований, анализировать полученные результаты; 2 этап: разрабатывать проекты в сфере экономики и бизнеса с учетом нормативно-правовых, ресурсных, административных и иных ограничений.	1 этап: владеть навыками подготовки соответствующих заданий для научных подразделений и отдельных исполнителей; 2 этап: обобщения имеющихся данных для составления финансовых обзоров, отчетов и научных публикаций в области финансов и кредита.
<b>ПК - 9</b> способностью оценивать финансовую эффективность разработанных проектов с учетом оценки финансово-экономических рисков и фактора неопределенности	1 этап: основы инвестиционного портфеля, расчета и анализа современной системы финансовых показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов на	1 этап: прогнозировать на основе стандартных теоретических и эконометрических моделей поведение экономических агентов, развитие экономических процессов и явлений на микро- и макроуровне;	1 этап: современными методами сбора, обработки и анализа экономических и социальных данных; 2 этап: современными методиками расчета и анализа

	микро- и макроуровне; 2 этап: принципы задания входных параметров CAPM.	2 этап: методы идентификации и оценки рисков при принятии финансовых решений, разработать мероприятия по их минимизации.	социально-экономических показателей, характеризующих экономические процессы и явления на микро- и макроуровне.
--	--	--	--

## **2. Содержание дисциплины:**

### **Раздел 1. Понятие, классификация и подходы к понятию финансовых активов корпораций**

Тема 1 Сущность и объекты финансовых инвестиций

Тема 2 Институциональное регулирование инвестиционной деятельности корпораций

Тема 3 Сущность и объекты финансовых инвестиций

### **Раздел 2 Корпоративные облигации, привилегированные и обыкновенные акции в инвестиционном портфеле корпорации**

Тема 4 Инвестиции в активы с фиксированным доходом

Тема 5 Методы оценки стоимости и доходности акций

### **Раздел 3 Теоретические подходы к формированию инвестиционного портфеля корпорации**

Тема 6 Теория формирования портфеля финансовых активов.

### **Раздел 4 Управление портфелем финансовых активов**

Тема 7 Стратегическое управление инвестиционным портфелем

Тема 8 Оценка риска инвестирования

Тема 9 Модели ценообразования на рынке капиталов

## **3. Общая трудоёмкость дисциплины: 4 ЗЕ.**