|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **Аннотация** | | |  |
| **Рабочей программы дисциплины** | | |  |
|  |  |  |  |
| Дисциплина | | Формирование инвестиционного портфеля | |
| Направление подготовки | | 38.04.08 Финансы и кредит | |
| Профиль | | Финансовые рынки и инвестиции | |
| Объем дисциплины | | 4 з.е | |
| Формы промежуточной аттестации | | Экзамен | |
| Кафедра финансов, денежного обращения и кредита | | | |
| **Краткое** **содержание** **дисциплины** | | | |
| Тема | Наименование темы | | |
| Тема 1. | Сущность и понятие инвестиционного портфеля. Принципы формирования инвестиционного портфеля | | |
| Тема 2. | Типы и разновидности инвестиционных портфелей | | |
| Тема 3. | Риски портфельного инвестирования и способы их оценки | | |
| Тема 4. | Инвестиционные стратегии и управление портфелем | | |
| Тема 5. | Моделирование целевого портфеля клиента | | |
|  |  |  |  |
| **Список** **литературы** | | | |
|  |  |  |  |
| **Основная литература:** | | | |
| 1. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций. [Электронный ресурс]:Практическое пособие. - Москва: Издательско- торговая корпорация "Дашков и К", 2020. - 544 – Режим доступа: https://znanium.com/catalog/product/1093535 | | | |
| 2. Алиев А.Т., Сомик К.В. Управление инвестиционным портфелем. [Электронный ресурс]:Учебное пособие. - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2020. - 158 – Режим доступа: https://znanium.com/catalog/product/1092978 | | | |
| 3. Шапкин А.С., Шапкин В.А. Управление портфелем инвестиций ценных бумаг. [Электронный ресурс]:Учебное пособие. - Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2019. - 502 – Режим доступа: https://znanium.com/catalog/product/1093011 | | | |
| 4. Никитина Т. В., Репета-Турсунова А. В., Фрёммель М., Ядрин А. В. Основы портфельного инвестирования. [Электронный ресурс]:Учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2020. - 195 – Режим доступа: https://urait.ru/bcode/452191 | | | |
| **Дополнительная литература:** | | | |
| 1. Бочаров В. В. Инвестиции. Инвестиционный портфель. Источники финансирования. Выбор стратегии.:учебник для вузов. - Санкт-Петербург: Питер, 2003. - 286 | | | |
| 2. Абрамов А. Е. Инвестиционные фонды. Доходность и риски, стратегии управления портфелем, объекты инвестирования в России.:учебное пособие для студентов, обучающихся по специальностям: "Финансы и кредит", "Бухгалтерский учет, анализ и аудит", "Мировая экономика", "Налоги и налогообложение" (протокол N5 от 26 апр. 2005 г.). - Москва: Альпина Бизнес Букс, 2005. - 414 | | | |
| 3. Шапкин А. С., Шапкин В. А. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций.:производственно-практическое издание. - Москва: Дашков и К°, 2012. - 543 | | | |

|  |
| --- |
| 4. Алиев А. Т., Сомик К. В. Управление инвестиционным портфелем.:учебное пособие. - Москва: Дашков и К°, 2013. - 160 |
| **Дополнительная литература:** |
| 1. Ширяев В. И. Модели финансовых рынков. Оптимальные портфели, управление финансами и рисками.:учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности "Математические методы в экономике" и другим экономическим специальностям. - Москва: [КомКнига], 2007. - 214 |
| 2. Ширяев В. И. Модели финансовых рынков. Оптимальные портфели, управление финансами и рисками.:учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по специальности "Математические методы в экономике" и другим экономическим специальностям, по направлению "Прикладная математика" и специальности "Прикладная математика". - Москва: URSS: [ЛИБРОКОМ], 2009. - 214 |
|  |
| **Перечень** **информационных** **технологий,** **включая** **перечень** **лицензионного** **программного** **обеспечения** **и** **информационных** **справочных** **систем,**  **онлайн** **курсов,** **используемых** **при** **осуществлении** **образовательного** **процесса** **по** **дисциплине** |
| **Перечень лицензионного программного обеспечения:** |
|  |
| Astra Linux Common Edition. Договор № 1 от 13 июня 2018, акт от 17 декабря 2018. Срок действия лицензии - без ограничения срока. |
| Microsoft Office 2016.Договор № 52/223-ПО/2020 от 13.04.2020, Акт № Tr000523459 от 14.10.2020 Срок действия лицензии 30.09.2023. |
| **Перечень информационных справочных систем, ресурсов информационно- телекоммуникационной сети «Интернет»:** |
| Справочно-правовая система Консультант +. Договор № 163/223-У/2020 от 14.12.2020. Срок действия лицензии до 31.12.2021 |
| Справочно-правовая система Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии -без ограничения срока |
| **«РТС»** **-** **Российская** **торговая** **система** **-** **http://www.rts.ru/**  http://www.rts.ru/ |
| **«Московская** **межбанковская** **валютная** **биржа»** **(ММВБ)** **-** **http://www.micex.ru/**  http://www.micex.ru/ |
| **«Росбизнесконсалтинг»** **-** **информационное** **агентство** **-** **http://www.rbc.ru**  http://www.rbc.ru |
| **Центральный** **банк** **Российской** **Федерации** **-** **http://www.cbr.ru**  http://www.cbr.ru |
| **«АК&М»** **-** **информационно-аналитическое** **агентство** **-** **http://www.akm.ru**  http://www.akm.ru |
| **«Финмаркет»** **-** **информационное** **агентство** **-** **http://www.quotes.ru**  http://www.quotes.ru |
| **«Экономика** **и** **жизнь»** **-** **агентство** **деловой** **информации** **-** **http://www.akdi.ru**  http://www.akdi.ru |
| **«МФД-инфоцентр»** **-** **информационное** **агентство** **-** **http://www.mfd.ru**  http://www.mfd.ru |
| **«Финанс-аналитик»**  **-**  **информация**  **о**  **финансовых**  **рынках**  **-**  **http://www.finam.ru**  http://www.finam.ru |

|  |
| --- |
| **Национальная**  **ассоциация**  **участников**  **фондового**  **рынка**  **-**  **http** **://www.naufor.ru/**  http ://www.naufor.ru/ |
| **Школа**  **инвестора**  **информационный**  **портал**  **http://school.onlinebroker.ru**  http://school.onlinebroker.ru |
| Аннотацию подготовил: Логинов Михаил Павлович |