|  |  |
| --- | --- |
|  **Аннотация** |  |
|  **Рабочей программы дисциплины** |  |
|  |  |  |  |
| Кафедра финансов, денежного обращения и кредита  |
| 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 |
| **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. 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., Миркин Я. М. 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 Гарант. Договор № 58419 от 22 декабря 2015. Срок действия лицензии -без ограничения срока   |
| Справочно-правовая система Консультант +. Договор № 163/223-У/2020 от 14.12.2020. Срок действия лицензии до 31.12.2021    |
|  **«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  |