

Документ подписан простой электронной подписью  
Информация о владельце:  
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич  
Должность: врио ректора  
Дата подписания: 28.09.2023 12:25:07  
Уникальный программный ключ:  
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf35f08

Министерство науки и высшего образования Российской Федерации  
ФГБОУ ВО «Тверской государственный университет»



Утверждаю:  
Руководитель ООП  
Толкаченко О.Ю.  
«16» июня 2021 г.

Рабочая программа дисциплины (с аннотацией)

**«Управление инвестиционным портфелем»**

Направление подготовки

**38.03.01 Экономика**

Направленность (профиль)

**«Финансовые рынки и банки»**

Для студентов 4 курса  
очной формы обучения,  
4, 5 курса очно-заочной формы обучения,  
4 курса заочной формы обучения

Составитель: Лепехин И.А.

Тверь, 2021

## **I. Аннотация**

### **1. Цель и задачи дисциплины**

Целью освоения дисциплины является: усвоение теоретических и практических основ формирования инвестиционного портфеля и управления им для достижения оптимальных соотношений доходности и риска, связанных с инвестиционными решениями.

Задачами освоения дисциплины являются:

- ✓ изучение сущности и видов инвестиций в целом, а также портфельных инвестиций в частности;
- ✓ изучение количественных характеристик различных видов ценных бумаг с использованием традиционных моделей ценообразования на фондовом рынке;
- ✓ изучение стратегических и тактических приемов управления различными видами инвестиционных портфелей, а также возможности комплексного управления комбинированным портфелем ценных бумаг.

### **2. Место дисциплины в структуре ООП**

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» относится к Блоку 1 дисциплин учебного плана части, формируемой участниками образовательных отношений, и направлена на формирование у обучающихся профессиональных компетенций.

Данная дисциплина логически и содержательно-методически связана с другими дисциплинами учебного плана, в частности с дисциплинами «Финансы», «Менеджмент», «Финансовые рынки», «Организация кредитного процесса», «Риски финансовой деятельности», «Банковский менеджмент», «Деньги, кредит, банки», «Экономика организации», «Методы оптимальных решений», «Основы экономического анализа», «Финансы домашних хозяйств», «Банковское дело», «Налоги и налогообложение организаций финансового сектора экономики» и другими. Предпосылками для изучения дисциплины являются знания и умения, полученные в ходе освоения таких дисциплин, как «Финансы», «Менеджмент», «Финансовые рынки», «Банковское дело», «Деньги, кредит, банки», «Финансы

домашних хозяйств», «Экономика организации», «Методы оптимальных решений», «Основы экономического анализа» и других.

Освоение дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» является предшествующим для изучения прохождения государственной итоговой аттестации.

**3. Объем дисциплины: 6 зачетных единиц, 216 академических часа, в том числе для очной формы обучения:**

**контактная аудиторная работа:** лекции 17 часов, практические занятия 34 часа;

**самостоятельная работа:** 138 часов; часы, отводимые на контроль - 27 часов.

**в том числе для очно-заочной формы обучения:**

**контактная аудиторная работа:** лекции 16 часов, практические занятия 20 часа;

**самостоятельная работа:** 153 часа; часы, отводимые на контроль - 27 часов.

**в том числе для очно-заочной формы обучения (ускоренное обучение на базе СПО):**

**контактная аудиторная работа:** лекции 14 часов, практические занятия 18 часа;

**самостоятельная работа:** 157 часов; часы, отводимые на контроль - 27 часов.

**в том числе для заочной формы обучения:**

**контактная аудиторная работа:** лекции 6 часов, практические занятия 12 часов;

**самостоятельная работа:** 189 часов; часы, отводимые на контроль – 9 часов.

**4. Планируемые результаты обучения по дисциплине, соотнесенные с планируемыми результатами освоения образовательной программы**

Планируемые результаты освоения образовательной программы (формируемые компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-4 Способен рассчитывать, анализировать и интерпретировать информацию, необходимую для разработки мероприятий по повышению эффективности потребительского кредитования	ПК-4.1 Проводит мониторинг кредитных продуктов
	ПК-4.2 Рассчитывает и анализирует показатели эффективности потребительского кредитования

**5. Форма промежуточной аттестации и семестр прохождения:**

**по очной форме** - экзамен в 7 семестре;

**по очно-заочной форме** – экзамен в 9 семестре;

**по очно-заочной форме (ускоренное обучение на базе СПО)** - экзамен в 7 семестре;

**по заочной форме** - экзамен в 7 семестре.

**6. Язык преподавания русский.**