

Аннотация учебной дисциплины «УПРАВЛЕНИЕ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ»

**для слушателей программы профессиональной переподготовки
«Рынок ценных бумаг и производных финансовых
инструментов: стратегии управления»**

Пояснительная записка

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» предназначена для подготовки специалистов в области инвестиций на фондовых рынках. Цель курса заключается в том, сообщить слушателям сумму знаний, компетенций и практических навыков, необходимых для работы на различных позициях в сфере инвестиций.

Программа дисциплины включает лекционные занятия, практические занятия в компьютерном классе, самостоятельное изучение литературы, освоение теоретического материала, написание реферата по одной или нескольким статьям из современных профессиональных зарубежных изданий, контрольной работы, проведение итогового письменного экзамена.

2. Место дисциплины в структуре образовательной программы

Для освоения учебной дисциплины, слушатели должны владеть следующими знаниями:

- знать принципы организации рынка ценных бумаг и основные характеристики обращающихся на нём инструментов;
- уметь пользоваться базами данных о ценах активов, ставках и др., представленными в общедоступных источниках;
- уметь производить математические и статистические расчёты с помощью табличных процессоров на персональном компьютере.

Тематическое содержание дисциплины

Тема 1. Введение в инвестиции.

Тема 2 Управление портфелем облигаций

Тема 3. Риск. Теория Г.Марковица

Тема 4. Предпочтения инвестора. Выбор оптимального портфеля.

Тема 5 Модель CAPM.

Тема 6. Факторные модели и АРТ.

Тема 7. Оценка эффективности управления портфелем

Учебно-методическая литература

7.1. Базовый учебник.

Рынок ценных бумаг, под общей редакцией Н.И. Берзона. М.: Юрайт, 2016.

7.2. Основная литература.

Шарп, Г.Александр, Д.Бейли "Инвестиции" М. Инфра-М, 2013.

Ф.Фабозци. Управление инвестициями. М. Инфра-М, 2000.

З.Боди, А.Кейн, А.Маркус. Принципы инвестиций. М. Вильямс, 2004.

А.С.Шведов. Теория эффективных портфелей ценных бумаг. М., ГУ-ВШЭ, 2005.