

**ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ БЮДЖЕТНОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ  
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ  
«САХАЛИНСКИЙ ГОСУДАРСТВЕННЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»**

**Аннотация рабочей программы дисциплины  
Б1.В.ДВ.14.02 «Управление собственным портфелем ценных бумаг в коммерческом  
банке»  
направление подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит»**

**1. Цели освоения дисциплины**

Целью освоения дисциплины «Управление собственным портфелем ценных бумаг в коммерческом банке» является формирование у бакалавров прочных теоретических знаний и практических навыков в области вложений денежных средств в различные ценные бумаги и управление ими.

**2. Место дисциплины в структуре образовательной программы**

Дисциплина Б1.В.ДВ.14.02 «Управление собственным портфелем ценных бумаг в коммерческом банке» относится к дисциплинам по выбору основной профессиональной образовательной программы по направлению подготовки 38.03.01 «Экономика», профиль «Финансы и кредит».

Дисциплина осваивается на 10 сессии (заочная). Трудоемкость дисциплины составляет – 3 зачетных единицы.

Дисциплина «Управление портфелем ценных бумаг в акционерном обществе» предшествует изучению таких курсов, как «Финансовые рынки», «Финансовый менеджмент».

**3. Требования к результатам освоения содержания дисциплины**

Процесс изучения дисциплины направлен на формирование элементов следующих компетенций в соответствии с ФГОС ВО по данному направлению:

- способность анализировать и интерпретировать финансовую, бухгалтерскую и иную информацию, содержащуюся в отчетности предприятий различных форм собственности, организаций, ведомств и т.д. и использовать полученные сведения для принятия управленческих решений (ПК-5);

- способность применять нормы, регулирующие бюджетные, налоговые, валютные отношения в области страховой, банковской деятельности, учета и контроля способностью, используя отечественные и зарубежные источники информации, собрать необходимые данные проанализировать их и подготовить информационный обзор и/или аналитический отчет (ПК-22).

В результате освоения дисциплины студент должен:

**Знать**

- знать сущность, общеэкономическое значение и особенности инвестирования в ценные бумаги.

**Уметь**

- определять эффективность инвестиционного проекта;
- усвоить современные концепции портфельного анализа, теории оптимизации инвестиционного портфеля;
- определять риск и доходность инвестиционного портфеля;
- применять методы и принципы формирования инвестиционного портфеля;
- выявлять необходимость и степень реструктуризации портфеля из ценных бумаг;
- выделять инвестиционные качества финансовых инструментов;
- анализировать международные портфельные инвестиции.

### Владеть

- методологией анализа операций с ценными бумагами с точки зрения сравнения, оценки финансового результата и вероятности получения дохода;
- осуществлять расчеты по всем видам операций с ценными бумагами.

#### 4. Структура дисциплины «Управление собственным портфелем ценных бумаг в коммерческом банке»

Общая трудоемкость дисциплины составляет 3 зачетных единицы, 108 часов, заочная форма обучения

№ п/п	Раздел Дисциплины	Семестр	Виды учебной работы, включая самостоятельную работу студентов и трудоемкость (в часах)					Формы текущего контроля успеваемости (по неделям семестра) Форма промежуточной аттестации (по семестрам)
			Лекции	Практ	СРС	Контр	Итого	
1	Системное управление портфелем. Построение портфеля	10	1	1	14	1	17	Контрольная работа
2	Типы портфелей	10	1	2	14	1	18	Опрос
3	Содержимое портфеля	10	1	1	14	0	16	Самостоятельная работа
4	Управление портфелем	10	1	4	14	1	20	Самостоятельная работа
5	Инвестиционные стратегии и управление портфелем	10	1	2	14	1	18	Опрос
6	Оценка эффективности портфеля	10	1	4	14	0	19	Контрольная работа
<b>Итого:</b>			<b>6</b>	<b>14</b>	<b>84</b>	<b>4</b>	<b>108</b>	<b>Зачет (4)</b>

#### 5. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

а) основная литература:

1. Хорев А.И. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебное пособие / А.И. Хорев, Л.Е. Совик, Е.В. Леонтьева. - Электрон. текстовые данные. - Воронеж: Воронежский государственный университет инженерных технологий, 2014. - 204 с. - 978-5-00032-053-2. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/47449.html>

2. Николаева И.П. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / И.П. Николаева. - Электрон. текстовые данные. - М. : Дашков и К, 2015. - 256 с. - 978-5-394-02413-9. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/35306.html>

3. Газалиев М.М. Рынок ценных бумаг [Электронный ресурс] : учебное пособие для бакалавров / М.М. Газалиев, В.А. Осипов. - Электрон. текстовые данные. - М. : Дашков и К, 2015. - 169 с. - 978-5-394-02534-1. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/35307.html>

4. Натепрова Т.Я. Учет ценных бумаг и финансовых вложений [Электронный ресурс] : учебное пособие / Т.Я. Натепрова, О.В. Трубицына. - Электрон. текстовые данные. - М. : Дашков и К, 2015. - 224 с. - 978-5-394-01994-4. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52256.html>

б) дополнительная литература

1. Алиев А.Т. Управление инвестиционным портфелем [Электронный ресурс] : учебное пособие / А.Т. Алиев, К.В. Сомик. - Электрон. текстовые данные. - М. : Дашков и К, 2015. - 159 с. - 978-5-394-01292-1. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52274.html>

2. Балдин К.В. Управление инвестициями [Электронный ресурс] : учебник для бакалавров / К.В. Балдин, Е.Л. Макриденко, О.И. Швайка. - Электрон. текстовые данные. - М. : Дашков и К, 2016. - 239 с. - 978-5-394-02235-7. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/60627.html>

3. Тепман Л.Н. Корпоративное управление [Электронный ресурс] : учебное пособие для студентов вузов, обучающихся по направлениям экономики и управления / Л.Н. Тепман. - Электрон. текстовые данные. - М. : ЮНИТИ-ДАНА, 2015. - 239 с. - 978-5-238-01550-7. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/52618.html>

4. Короткий С.В. Корпоративное управление [Электронный ресурс] : учебное пособие / С.В. Короткий. - Электрон. текстовые данные. - Саратов: Вузовское образование, 2018. - 230 с. - 978-5-4487-0135-1. - Режим доступа: <http://www.iprbookshop.ru/72357.html>

в) программное обеспечение и интернет-ресурсы

#### **Информационно-образовательные ресурсы**

–Официальный Web-сайт СахГУ <http://sakhgu.ru/>; [sakhgu.pf](http://sakhgu.pf)

–Система управления обучением на базе Moodle <http://cdo.sakhgu.ru/>

–Система независимого компьютерного тестирования в сфере образования <http://i-exam.ru/>

–Сайт научной электронной библиотеки eLIBRARY <http://elibrary.ru>

–Сайт университетской библиотеки ONLINE <http://www.biblioclub.ru/>

–Сайт российской государственной библиотеки <http://www.rsl.ru/>

–Сайт электронно-библиотечной системы IPRbooks <http://www.iprbookshop.ru>

–Сайт информационно правовой системы Консультант Плюс <http://www.consultant.ru>

–Сайт информационной справочной системы Polpred.com [http:// polpred.com/](http://polpred.com/)

–Сайт национальной электронной библиотеки <https://нэб.рф>

–Сайт электронного издательства ЮРАЙТ <https://www.biblio-online.ru>

#### **Информационные технологии и программное обеспечение**

– Система технической поддержки и обработки заявок <http://help.sakhgu.net>.

– Программный комплекс «Электронные журналы», используемый для учета и анализа успеваемости обучающихся;

– «Антиплагиат. ВУЗ» Лицензионный договор №194 от 22.03.2018 года;

– Microsoft Windows Professional 7 Russian Upgrade Academic OPEN, (бессрочная), (лицензия 60939880);

– Microsoft Office Professional Plus 2010 Russian Academic OPEN, (бессрочная), (лицензия 60939880);

– Kaspersky Anti-Virus (лицензия 2022-000451-54518460), срок пользования с 2017-02-22 по 2019-02-24;

– АBBYYFineReader 11 Professional Edition (лицензия AF11-2S1P01-102/AD),

– Справочно-правовая система "Консультант Плюс", сетевая студенческая версия версия «проф». В составе базы: «Судебная практика», «Сахалинский выпуск», «Законопроекты», «деловые бумаги», «международное право», «финансист», «эксперт-приложение», «документы СССР», «комментарии законодательства», «консультации для бюджетных организаций»;

– Справочно-правовая система "Консультант Плюс", сетевая версия «проф». В составе базы: «документы СССР», «бюджетные организации», «строительство», «суды общей юрисдикции», «сахалинский выпуск», «деловые бумаги», «корреспонденция счетов», «международное право», «эксперт-приложение»;

– Программный комплекс «Планы», «Планы СПО» Договор № 4782 от 15.02.2018 года;

– «Диплом-стандарт». Договор № 13651 от 14.05.2013 года (продлонгация от 18.01.2017);

– «Диплом-стандарт». Договор № 12209 от 14.06.2013 года (продлонгация от 18.01.2017)

Автор



ст.преподаватель Питиляк Д.А.

Рецензент



к.э.н., доцент Карякина И. Е.

Рассмотрена на заседании кафедры 02 июля 2018 г., протокол № 15.

Утверждена на совете института 10 июля 2018 г., протокол № 10/37.