

**Аннотация к рабочей программе дисциплины**  
**«Инвестиционные стратегии в банковской деятельности»**

Учебный курс «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» предназначен для студентов 38.03.01 «Экономика».

Дисциплина «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» включена в состав вариативной части блока «Дисциплины (модули)».

Общая трудоемкость дисциплины составляет 8/8 зачетных единиц, 288/288 часов. Учебным планом предусмотрены лекционные занятия (36/12 часов), практические занятия (54/22 часа, в том числе МАО 36/14 часов), самостоятельная работа студентов (198/254 часа, в том числе 36/9 часов на подготовку к экзамену). Дисциплина реализуется на 4/5 курсе в 7 семестре.

Дисциплина «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» основывается на знаниях, умениях и навыках, полученных в результате изучения дисциплин «Общая теория денег и кредита», «Банковское дело», «Современные кредитные технологии» и позволяет подготовить студента к прохождению преддипломной практики и написания выпускной квалификационной работы.

Содержание дисциплины состоит из 2 разделов и охватывает следующий круг вопросов:

1. Финансовые инструменты и рынок ценных бумаг: предпосылки появления, краткое содержание и основные определения; представление и раскрытие в отчетности информации о финансовых инструментах в соответствии с МСФО 32; признание и оценка финансовых активов и обязательств в МСФО 39, сравнение с российской практикой; хеджирование (хеджируемые статьи и хеджирующие инструменты): раскрытие информации в соответствии с МСФО 39; финансовые инструменты и рынок ценных бумаг, основные методы его анализа; анализ финансовых активов по справедливой стоимости с отнесением ее изменений на счета прибылей или

убытков; анализ инвестиционных финансовых инструментов (удерживаемых до погашения и имеющихся в наличии).

2. Коммерческие банки на рынке ценных бумаг: функции, цели и основные операции; инвестиционные операции банков; портфельное управление вложениями банка в ценные бумаги. Стратегия управления рыночным риском; управление операциями по перепродаже; изменение рыночного риска; стоимость под риском (VAR); тестирование на стрессовые факторы.

**Цель** – содействие студентам в изучении стратегии коммерческих банков при совершении операций с ценными бумагами на первичном и вторичном фондовых рынках и о механизмах регулирования профессиональной деятельности на рынке ценных бумаг.

**Задачи:**

- изучить состав и структуру финансового рынка, виды и классификацию ценных бумаг;
- дать характеристику основных видов банковских операций и услуг, методов управления активами и пассивами, способов защиты от финансовых рисков при проведении инвестиционной политики;
- овладеть навыками применения действующих на рынке финансовых инструментов, уметь оценивать риск и доходность ценных бумаг;
- определять стоимость действующих на рынке финансовых инструментов;
- знать особенности применения различных инструментов управления финансовыми рисками.

Для успешного изучения дисциплины «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» у обучающихся должны быть сформированы следующие предварительные компетенции:

- способность использовать современные методы и технологии (в том числе информационные) в профессиональной деятельности;

- способность использовать основы экономических знаний в различных сферах деятельности;
- способность использовать основы правовых знаний в различных сферах деятельности;
- способность собрать и проанализировать исходные данные, необходимые для расчета экономических и социально-экономических показателей, характеризующих деятельность хозяйствующих субъектов.

В результате изучения данной дисциплины у обучающихся формируются следующие общепрофессиональные и профессиональные компетенции (элементы компетенций):

| Код и формулировка компетенции   | Этапы формирования компетенции |   |
|--|--------------------------------|---|
| ОПК – 2 способность осуществлять сбор, анализ и обработку данных, необходимых для решения профессиональных задач   | Знает                          | основные подходы и способы сбора, анализа и обработки информации о финансовых рынках и ключевые задачи, стоящие перед сотрудниками финансовых институтов                                |
|  | Умеет                          | осуществлять и организовывать процесс сбора и обработки информации о рынке ценных бумаг, идентифицировать риски, возникающие в процессе операций с финансовыми активами и инструментами |
|  | Владеет                        | навыками анализа финансовых рынков, финансовых рисков, возникающих при реализации профессиональных задач  |
| ПК – 4 способность на основе описания экономических процессов и явлений строить стандартные теоретические и экономические модели, анализировать и содержательно интерпретировать полученные результаты | Знает                          | основные экономические процессы и явления, возникающие в ходе деятельности разнообразных финансовых институтов  |
|  | Умеет                          | идентифицировать риски, возникающие в процессе операций с разнообразными финансовыми активами и инструментами   |
|  | Владеет                        | навыками анализа и оценки финансовых рисков и интерпретация полученных результатов  |

Для формирования вышеуказанных компетенций в рамках дисциплины «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» применяются следующие методы активного/ интерактивного обучения: дискуссия, кейс-стади.