

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

Учебный курс «Инвестиционные стратегии в банковской деятельности» предназначен для студентов направления 38.03.01 Экономика (двудипломная программа с ВШЭ).

Дисциплина включена в состав модуля 5 «Банковское дело» дисциплин по выбору вариативной части блока «Дисциплины (модули)».

Общая трудоемкость дисциплины составляет 7 зачетных единиц, 252 часа. Учебным планом предусмотрены лекционные занятия (36 часов), практические занятия (54 часа, в том числе МАО 36 часов), самостоятельная работа студентов (162 часа, в том числе 36 часа на подготовку к экзамену). Дисциплина реализуется на 4 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», «Финансовые рынки и финансово-кредитные институты» и позволяет подготовить студентов к освоению ряда таких дисциплин, как «Банковский менеджмент».

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:**

- 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:

- знать структуру финансового и кредитного рынка, особенности денежного обращения и ценных бумаг;
- умение использовать нормативно-правовую базу при классификации финансовых инструментов, определять участников финансовых сделок;

– владеет первичными навыками анализа рынка ценных бумаг: структура, доходность, риски.

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 в банковской деятельности
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 модели, возникающие в ходе деятельности банковских институтов на финансовом рынке
	Умеет	идентифицировать риски, возникающие в процессе операций с разнообразными финансовыми активами и инструментами коммерческого банка
	Владеет	Навыками анализа и оценки финансовых рисков банка и интерпретация полученных результатов

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