

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Смирнов Сергей Николаевич
Должность: врио ректора
Дата подписания: 06.06.2022 16:44:49
Уникальный программный ключ:
69e375c64f7e975d4e8830e7b4fcc2ad1bf35f08

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



Утверждаю:
Руководитель ООП:
Соломаха Г.М.
«1» июля 2019 г.

Рабочая программа дисциплины (с аннотацией)

МЕТОДЫ ОПТИМИЗАЦИИ ИНВЕСТИЦИОННОГО ПОРТФЕЛЯ

Направление подготовки
09.04.03 - Прикладная информатика

Профиль
Прикладная информатика в аналитической экономике

для студентов 2 курса магистратуры

Форма обучения
Очная

Составители:
д.ф.-м.н., профессор А.В. Язенин

Тверь 2019

I. Аннотация

1. Цель и задачи дисциплины

Целью дисциплины является освоение теории портфельного анализа в рамках вероятностного подхода.

Задачами дисциплины являются:

- изучение методов оптимизации инвестиционного портфеля;
- формирование навыков их практического применения при формировании эффективных инвестиционных портфелей.
-

2. Место дисциплины в структуре ООП

Учебная дисциплина относится к разделу «Профессиональный» части учебного плана, формируемой участниками образовательных отношений.

Предварительные знания и умения: для успешного изучения и освоения материала студентам необходимо знать основные понятия теории вероятностей и возможностей, математической статистики, исследования операций и методы оптимизации, линейной алгебры, математического анализа.

3. Объем дисциплины: 3 зачетных единицы, 108 академических часов, в том числе:

контактная аудиторная работа: лекции 15 часов, практические занятия 30 часов;

самостоятельная работа: 63 часа, в том числе контроль 18 часов.

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

Планируемые результатами освоения образовательной программы (формируемые компетенции)	Планируемые результаты обучения по дисциплине
ПК-1. Способен использовать и развивать методы научных исследований и инструментарий в области проектирования и управления информационными системами в экономике	ПК-1.1. Выявляет и формализует требования к информационным системам конкретного назначения, обеспечивающим информатизацию экономических процессов организаций и предприятий различного уровня ПК-1.2. Проводит формальную постановку прикладных задач макро и микроэкономики и задач разработки прикладного алгоритмического обеспечения информационных систем в экономике

	<p>ПК-1.3. Предлагает и реализует метод решения задач в области проектирования и управления информационными системами в экономике</p> <p>ПК-1.4. Осуществляет аттестацию результатов научных исследований с использованием математического моделирования исследуемых задач</p>
<p>ПК-3. Способен адаптировать и развивать современные методы и инструментальные средства прикладной информатики для автоматизации и информатизации решения прикладных задач различных классов и создания ИС</p>	<p>ПК-3.1. Проводит декомпозицию процесса автоматизации и информатизации прикладной задачи</p> <p>ПК-3.2. Решает отдельные подзадачи декомпозированного процесса автоматизации и информатизации</p> <p>ПК-3.3. Проектирует архитектуру программного обеспечения прикладной ИС</p>
<p>ПК-4. Способен принимать эффективные проектные решения в условиях неопределенности и риска</p>	<p>ПК-4.1. Использует вероятностно-статистические модели и модели теории нечетких множеств для описания неопределенности и формализации задач выбора проектных решений</p> <p>ПК-4.2. Предлагает и реализует методы выбора проектных решений в условиях неопределенности и риска</p>

5. Форма промежуточной аттестации зачет, 3 семестр.

6. Язык преподавания русский.