

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 18.05.2025 10:26:55
Уникальный программный ключ:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae188

Федеральное государственное автономное образовательное учреждение высшего образования «Российский университет дружбы народов» имени Патриса Лумумбы

Институт мировой экономики и бизнеса

(наименование основного учебного подразделения (ОУП)-разработчика ОП ВО)

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

ФОРМИРОВАНИЕ И УПРАВЛЕНИЕ МЕЖДУНАРОДНЫМ ИНВЕСТИЦИОННЫМ ПОРТФЕЛЕМ

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.04.01 «ЭКОНОМИКА»

(код и наименование направления подготовки/специальности)

Освоение дисциплины ведется в рамках реализации основной профессиональной образовательной программы высшего образования (ОП ВО):

«Мировые финансы и бизнес»

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2023 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Основной целью дисциплины «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» является освоение студентами знаний и практических навыков управления ресурсами организации, привлечения необходимого капитала.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» направлено на формирование у обучающихся следующих компетенций (части компетенций):

Таблица 2.1. Перечень компетенций, формируемых у обучающихся при освоении дисциплины (результаты освоения дисциплины)

Шифр	Компетенция	Индикаторы достижения компетенции (в рамках данной дисциплины)
УК-2	Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1. Формулирует проблему, решение которой напрямую связано с достижением цели проекта; УК-2.2. Определяет связи между поставленными задачами и ожидаемые результаты их решения; УК-2.3. В рамках поставленных задач определяет имеющиеся ресурсы и ограничения, действующие правовые нормы УК-2.4. Анализирует план-график реализации проекта в целом и выбирает оптимальный способ решения поставленных задач, исходя из действующих правовых норм и имеющихся ресурсов и ограничений УК-2.5. Контролирует ход выполнения проекта, корректирует план-график в соответствии с результатами контроля
ОПК-2	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	ОПК-2.1 Обладает знаниями о продвинутых инструментальных методах экономического анализа
		ОПК-2.2 Умеет применять знания о продвинутых инструментальных методах экономического и финансового анализа при проведении прикладных и/или фундаментальных исследований
ОПК-4	Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	ОПК-4.1 Разрабатывает организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности
		ОПК-4.2 Владеет навыками аргументированного убеждения в поддержку предлагаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений
		ОПК-4.3 Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений
ОПК-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении	ОПК-5.1 Знает современные информационные технологии и программные средства, применяемые при решении профессиональных задач
		ОПК-5.2 Умеет среди современных информационных технологий и программных

	профессиональных задач	средств выбирать наиболее эффективные для решения профессиональных задач ОПК-5.3 Владеет в полной мере навыками решения стандартных задач профессиональной деятельности с применением информационных технологий и программных средств
ПК-2	Разработка плана внешнеэкономической деятельности организации и контроль его выполнения	ПК-2.1. Знает особенности и виды международных коммерческих операций; ПК-2.2. Управлять ресурсами для осуществления внешнеэкономической деятельности организации
ПК-4	Анализ, оценка и контроль результатов финансово-экономической деятельности брокерско-дилерской организации (управляющей организации, депозитария, организатора торговли на финансовом рынке, клиринговой организации, регистратора, акционерного инвестиционного фонда), отчет о деятельности регулирующему органу, иным административным органам	ПК-4.1 Владеет методами финансово-аналитической работы ПК-4.2 Применяет методы количественной и качественной оценки для управления бизнес-процессами организации ПК-4.3 Знает бухгалтерский учет и финансовый анализ
ПК-5	Составление и представление финансовой отчетности экономического субъекта	ПК-5.1. Формирование числовых показателей отчетов, входящих в состав бухгалтерской (финансовой) отчетности; ПК-5.2. Владеет методами финансового анализа информации, содержащейся в бухгалтерской (финансовой) отчетности, устанавливать причинно-следственные связи изменений, произошедших за отчетный период, оценивать потенциальные риски и возможности экономического субъекта в обозримом будущем; ПК-5.3. Обосновывает принятые экономическим субъектом решения при проведении внутреннего контроля, внутреннего и внешнего аудита

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» относится к обязательной части, формируемой участниками образовательных отношений блока Б1 ОП ВО.

В рамках ОП ВО обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем».

Таблица 3.1. Перечень компонентов ОП ВО, способствующих достижению запланированных результатов освоения дисциплины

Шифр	Компетенция	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-2	Способен управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Международное управление риском Оценка международного бизнеса Международный банкинг Формирование и управление международным инвестиционным портфелем	Преддипломная практика
ОПК-2	Способен применять продвинутое инструментальные методы экономического анализа в прикладных и/или фундаментальных исследованиях	"Макроэкономика (продвинутый уровень)" "Эконометрика (продвинутый уровень)" Математические методы в международных финансах и бизнесе Международные финансы	Преддипломная практика
ОПК-4	Способен принимать экономически и финансово обоснованные организационно - управленческие решения в профессиональной деятельности и нести за них ответственность	Цифровые модели международного бизнеса Международный финансовый менеджмент	Преддипломная практика
ОПК-5	Способен использовать современные информационные технологии и программные средства при решении профессиональных задач	Международный финансовый менеджмент Формирование и управление международным инвестиционным портфелем	Преддипломная практика
ПК-2	Разработка плана внешнеэкономической деятельности организации и контроль его выполнения	Оценка международного бизнеса Формирование и управление международным инвестиционным портфелем	Преддипломная практика

ПК-4	Анализ, оценка и контроль результатов финансово-экономической деятельности брокерско-дилерской организации (управляющей организации, депозитария, организатора торговли на финансовом рынке, клиринговой организации, регистратора, акционерного инвестиционного фонда), отчет о деятельности регулируемому органу, иным административным органам	Международные операции с финансовыми и товарными активами Agile / Методологии гибкого управления проектами Environmental, Social, and Corporate Governance (ESG) / Экологическое, социальное и корпоративное управление Международный банкинг Международный финансовый менеджмент Формирование и управление международным инвестиционным портфелем	Преддипломная практика
ПК-5	Составление и представление финансовой отчетности экономического субъекта	Agile / Методологии гибкого управления проектами Environmental, Social, and Corporate Governance (ESG) / Экологическое, социальное и корпоративное управление	Преддипломная практика

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» составляет 3 зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения ОП ВО для **ОЧНОЙ** формы обучения

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		5	6	7	8
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	34			34	
в том числе:					
Лекции (ЛК)	17			17	
Лабораторные работы (ЛР)	-			-	
Практические/семинарские занятия (СЗ)	17			17	
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	56			56	
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	18			18	
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108		108	
	зач.ед.	3		3	

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 5.1. Содержание дисциплины (модуля) по видам учебной работы

№п/п	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
1	Методологические основы портфельного инвестирования; мировой рынок товаров, валюты, ценных бумаг	Инвестирование капитала и его виды. Методологические основы портфельного инвестирования, экономическая сущность и формы. Привлекательность портфельного инвестирования. Рынок денег и рынок капиталов, основные задачи, решаемые фондовым рынком. Понятие инвестиционного портфеля. Типы портфеля, принципы и этапы формирования. Стратегия управления портфелем.	ЛК, СЗ
2	Принципы формирования инвестиционного портфеля иностранных компаний	Принцип консервативности. Принцип диверсификации. Принцип достаточной ликвидности. Портфель роста. Портфель дохода. Портфель роста и дохода. Связь целей инвестирования со структурой портфеля.	ЛК, СЗ
3	Структура портфеля	Портфели денежного рынка. Портфель ценных бумаг, освобожденных от налога. Портфель, состоящий из ценных бумаг государственных структур. Портфель, состоящий из ценных бумаг различных отраслей промышленности.	СЗ
4	Инвестиционные стратегии и управление портфелем	Активная модель управления. Пассивная модель управления. Тактика управления инвестиционным портфелем. Задача управления процентным риском и теория иммунизации. Оптимизация рисков портфеля ценных бумаг и теория игр. Теория оптимального портфеля Марковица.	ЛК

5	Проблемы портфельного инвестирования в условиях рынка США и Европы	Проблемы взаимодействия клиентов и доверительных управляющих. Проблемы моделирования и прогнозирования. Проблемы оптимального достижения целей инвестирования. Проблема постановки задачи управления портфелем.	СЗ
6	Оценка эффективности инвестиционных проектов	Текущий чистый дисконтированный доход. Индекс рентабельности. Дисконтированный срок окупаемости. Внутренняя норма доходности.	ЛК, СЗ

6. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Таблица 6.1. Материально-техническое обеспечение дисциплины

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
Лекционная	Аудитория для проведения занятий лекционного типа, оснащенная комплектом специализированной мебели; доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	Лекции по курсу «Финансовый менеджмент» проводятся с использованием презентаций лекционного материала. Поэтому в процессе проведения занятий используется мультимедийная техника (проектор, ноутбук, активная доска).
Лаборатория	Аудитория для проведения лабораторных работ, индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и оборудованием.	
Семинарская	Аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, Оснащенная комплектом специализированной мебели и	Мультимедийная техника (проектор, ноутбук, интерактивная доска Плакаты, схемы.

	техническими средствами мультимедиа презентаций.	
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве 20 шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	Мультимедийная техника (проектор, ноутбук, активная доска). Торговые терминалы, вычислительные и графические программы -21 рабочее место: сист.блок Celeron /2600 MHz/1280 MB/ 40 GB/DVD ROM/ LCD monitor 17"+ 1 проектор + Точка доступа WiFi -1С Предприятие 7.7 -Eviews -IT Audit -Mentor -MetaTrader -Microsoft Office 2007 -Microsoft Project 2007 -NetOp School -Project Expert 7 Tutorial -SAP -Spider Project -SPSS for Windows -Галактика 7.12.01 (Однопользовательская)
Для самостоятельной работы обучающихся	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	Мультимедийная техника (проектор, ноутбук, активная доска). Торговые терминалы, вычислительные и графические программы

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

Инвестиции [электронный ресурс] : Учебное пособие. Специальность 080105

– "Финансы и кредит" / О. А. Ашихмина, И. А. Марьина. - электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2011. - 149 с. - ISBN 978-5-20904057-6.

Оценка эффективности инвестиционных проектов в программе PROJECT EXPERT [Электронный ресурс] : Учебное пособие / В. Б. Смирнов, И. В. Лазанюк. - Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2013. - 144 с. - ISBN978-5-209-04981-4.

Рынок ценных бумаг [Текст/электронный ресурс] : Практикум / Т. К. Блохина. - М. : Изд-во РУДН, 2012. - 60 с. - ISBN 978-5-209-04895-4 : 61.47.

Дополнительная литература:

Инвестиции : Учебник / А. Ю. Андрианов, Г. В. Кальварским; Отв. ред.: В.В.Ковалев, В.В.Иванов, В.А.Лялин. - 2-е изд., перераб. и доп. - М. : Проспект, 2011.

- 592 с. : ил. - ISBN 978-5-392-01650-1

Инновации и инвестиции в деятельности организации [Электронный ресурс] : Монография / А. А. Чурсин, Окачев Николай Аркадьевич. - М. : Машиностроение, 2010. - 469 с. - ISBN 978-5-94275-531-7.

Инвестиции [Электронный ресурс] : Учебник / И. П. Николаева. - Электронные текстовые данные. - 2013 : ИК "Дашков и К", 2013. - 256 с. - ISBN 978-5-394-01410-9.

Ресурсы информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»:

1. ЭБС РУДН и сторонние ЭБС, к которым студенты университета имеют доступ на основании заключенных договоров:

- Электронно-библиотечная система РУДН – ЭБС РУДН <http://lib.rudn.ru/MegaPro/Web>
- ЭБС «Университетская библиотека онлайн» <http://www.biblioclub.ru>
- ЭБС Юрайт <http://www.biblio-online.ru>
- ЭБС «Консультант студента» www.studentlibrary.ru
- ЭБС «Лань» <http://e.lanbook.com/>
- ЭБС «Троицкий мост»

2. Базы данных и поисковые системы:

- электронный фонд правовой и нормативно-технической документации <http://docs.cntd.ru/>
- поисковая система Яндекс <https://www.yandex.ru/>
- поисковая система Google <https://www.google.ru/>
- реферативная база данных SCOPUS <http://www.elsevierscience.ru/products/scopus/>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля:*

1. Курс лекций по дисциплине «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем».

2. Методические указания по выполнению и оформлению курсовой работы/проекта по дисциплине «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» (при наличии КР/КП).

<https://esystem.rudn.ru/course/view.php?id=12188>

8. ОЦЕНОЧНЫЕ МАТЕРИАЛЫ И БАЛЛЬНО-РЕЙТИНГОВАЯ СИСТЕМА ОЦЕНИВАНИЯ УРОВНЯ СФОРМИРОВАННОСТИ КОМПЕТЕНЦИЙ ПО ДИСЦИПЛИНЕ

Оценочные материалы и балльно-рейтинговая система* оценивания уровня сформированности компетенций (части компетенций) по итогам освоения дисциплины «Формирование и управление международным инвестиционным портфелем» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

* - Ом и БРС формируются на основании требований соответствующего локального нормативного акта РУДН.

РАЗРАБОТЧИКИ:

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

Руководитель программы

Должность, БУП



Айдрус И.А.

Подпись

Фамилия И.О.