

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 06.06.2022 16:55:05
Уникальный программный идентификатор:
ca953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

**Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования «Российский университет дружбы народов»**

Экономический факультет

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

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Управление инвестиционным портфелем

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.04.08 Финансы и кредит

(код и наименование направления подготовки/специальности)

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

Современные финансовые технологии в инвестировании и банковском бизнесе

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2022 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Целью освоения дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» является формирование у студентов прочных теоретических знаний и практических навыков в области вложений денежных средств в различные ценные бумаги и управление ими.

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Управление 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-1	Способность осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	УК-1.1 - Описывает и аргументировано диагностирует ситуацию как проблемную
		УК-1.2 - Критически и всесторонне анализирует проблемную ситуацию на основе системного подхода, выявляя ее компоненты и причинно-следственные связи"
		УК-1.3 - Формирует стратегию действий в выработать проблемной ситуации: выработывает обоснованные варианты ее оценивая возможные риски и предлагая пути их нейтрализации, осуществляет мониторинг принятых решений
УК-2	Способность управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	УК-2.1 - Формулирует концепцию проекта, определяя цель, задачи, актуальность и значимость, ожидаемые результаты сферы применения, ресурсы и ограничения, регламентированные рамки, выполнения, алгоритмы действий
		УК-2.2 - Разрабатывает проект; ведет проектную документацию; формирует команду и организует ее работу на всех этапах проекта
		УК-2.3 - Организует мониторинг проектной деятельности на всех этапах жизненного цикла; реализует внедрение проекта и представляет документированные результаты
ОПК-2	Способность применять продвинутое инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе, с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем	ОПК-2.1 - Оценивает специфику прикладного и (или) фундаментального исследования в области финансовых методов отношений, определяющую или ограничивающую выбор и инструментального метода экономического и финансового в анализа."
		ОПК-2.2 - Формирует совокупность исходных данных, удовлетворяющую исходным предпосылкам применения продвинутого инструментальных методов экономического и финансового анализа.
		ОПК-2.3 - Осуществляет последовательность процедур, составляющих суть метода экономического и финансового анализа, и оценивает полученные результаты, в том числе с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем.

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Управление инвестиционным портфелем» относится к базовой части блока Б1 ОП ВО.

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

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

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
УК-1	Способность осуществлять поиск, критический анализ проблемных ситуаций на основе системного подхода, выработать стратегию действий	Стратегии и современная модель управления в сфере денежно-кредитных отношений Инвестиционный менеджмент	Государственно-частное партнерство Проектное финансирование и экспертиза технико-экономического обоснования Управление финансовыми рисками и валютными позициями Оценка рискованности ценных бумаг
УК-2	Способность управлять проектом на всех этапах его жизненного цикла	Инвестиционный менеджмент Механизмы реализации инвестиционных проектов в ТЭК стран мира Эконометрика финансовых рынков Financial risk management	Оценка и управление стоимостью банка Инновационные инструменты финансирования бизнеса Управление портфелем ценных бумаг
ОПК-2	Способность применять продвинутые инструментальные методы экономического и финансового анализа в прикладных и (или) фундаментальных исследованиях в области финансовых отношений, в том числе, с использованием интеллектуальных информационно-аналитических систем	Математическое обеспечение инвестиционных решений	Управление процессом внедрения финансовых технологий Современные платежные технологии Государственно-частное партнерство Проектное финансирование и экспертиза технико-экономического обоснования Инновационные инструменты финансирования бизнеса Управление портфелем ценных бумаг

* - заполняется в соответствии с матрицей компетенций и СУП ОП ВО

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Управление инвестиционным портфелем» составляет 3 зачетных единиц.

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

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.	Семестр(-ы)			
		1	2	3	4
Контактная работа, ак.ч.	36		36		
в том числе:					
Лекции (ЛК)					
Лабораторные работы (ЛР)					
Практические/семинарские занятия (СЗ)	36		36		
Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.	63		63		
Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.	9		9		
Общая трудоемкость дисциплины	ак.ч.	108	108		
	зач.ед.	3	3		

5. СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

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

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
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.	СЗ - 6
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.	СЗ - 6
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 - 6
Инвестиционные стратегии и управление портфелем	Активная модель управления. Пассивная модель управления. Тактика управления инвестиционным портфелем. Задача	СЗ - 6

Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)	Вид учебной работы*
	управления процентным риском и теория иммунизации. Оптимизация рискового портфеля ценных бумаг и теория игр. Теория оптимального портфеля Марковица.	
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.	СЗ - 6

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – семинарские занятия.

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)
Компьютерный класс	Компьютерный класс для проведения занятий, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная персональными компьютерами (в количестве ___ шт.), доской (экраном) и техническими средствами мультимедиа презентаций.	<p>ауд. 430 Моноблок Lenovo AIO-300-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21"</p> <p>MS Windows 10 64bit 86626883 Microsoft Office 2016 86626883 Expert Systems 18487N SAP договор № С-16/15 Корпорация Галактика free Система БЭСТ-ОФИС 40475 Eviews10 70U00460 7-Zip free FastStone Image Viewer free FreeCommander free Adobe Reader free</p>

Тип аудитории	Оснащение аудитории	Специализированное учебное/лабораторное оборудование, ПО и материалы для освоения дисциплины (при необходимости)
		К-Lite Codec Pack free Альт-Инвест Сумм 8 95326045 Альт-Финансы 3 80603974 MS Power BI Desktop free

* - аудитория для самостоятельной работы обучающихся указывается **ОБЯЗАТЕЛЬНО!**

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 ПРОЕКТ EXPERT [Электронный ресурс] : Учебное пособие / В. Б. Смирнов, И. В. Лазанюк. - Электронные текстовые данные. - М. : Изд-во РУДН, 2013. - 144 с. - ISBN 978-5-209-04981-4.

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, Окатьев 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 «Управление инвестиционным портфелем».

<https://esystem.rudn.ru/course/view.php?id=5802>

* - все учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся размещаются в соответствии с действующим порядком на странице дисциплины **в ТУИС!**

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 «Управление инвестиционным портфелем» представлены в Приложении к настоящей Рабочей программе дисциплины.

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

РАЗРАБОТЧИКИ:

Доцент, «Финансы и кредит»



Абрамов Г.Ф.

Должность, БУП

Подпись

Фамилия И.О.

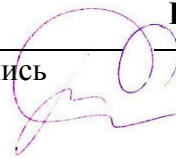
И.о. зав. кафедрой «Финансы
и кредит»

Е.М. Григорьева

Наименование БУП

Подпись

Фамилия И.О.



РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

**профессор кафедры
«Финансы и кредит»**



А.Я. Быстряков
