

Компонент ОПОП

38.04.01 Экономика, направленность (профиль) «Финансовый  
аналитик»

наименование ОПОП

ФТД.02

шифр дисциплины

## РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

Дисциплины (модуля)

Формирование оптимального инвестиционного портфеля

Разработчик:

Царева С.В.

ФИО

Декан ФПКВК

должность

К.Э.Н., доцент

ученая степень, звание

Утверждено на заседании кафедры

цифровых технологий, математики и экономики

наименование кафедры

протокол №

8

от

21.04.2022

И.о. заведующего кафедрой

ЦТМиЭ

Мотина Т. Н.

ФИО

подпись

Мурманск  
2022

## Пояснительная записка

Объем дисциплины 2 з.е.

**1. Результаты обучения по дисциплине (модулю), соотнесенные с индикаторами достижения компетенций, установленными образовательной программой**

Компетенции	Индикаторы достижения компетенций	Результаты обучения по дисциплине (модулю)
ПК-4. Способен составлять инвестиционный портфель и управлять инвестиционным риском	ИД-1 <sub>ПК-4</sub> : - понимает методы дисконтирования денежных потоков, методы многовариантности расчетов, методы математического моделирования и количественной оптимизации; принципы расчета доходности активов; принципы портфельного управления инвестированием; принципы соотношения риска и доходности; способы управления финансовыми рисками ИД-2 <sub>ПК-4</sub> : - составляет инвестиционный портфель ИД-3 <sub>ПК-4</sub> : - рассчитывает величину портфеля, достаточную для покрытия финансовых целей; моделирует целевой портфель; рассчитывает параметры целевого инвестиционного портфеля; определяет критерии качества инвестиционного портфеля; анализирует изменения стоимости капитала инвестиционного портфеля	<b>Знать:</b> - понятие инвестиционного портфеля, его виды; - методы управления портфелем реальных инвестиций; - методы оценки эффективности вложений в инвестиционный портфель с учетом риска. <b>Уметь:</b> - применять методы портфельного анализа для обеспечения требуемого уровня доходности; - оценивать доходность портфеля реальных инвестиций. <b>Владеть:</b> - навыками составления оптимального портфеля реальных инвестиций.

## 2. Содержание дисциплины (модуля)

### Тема 1. Инвестиционный проект как объект экономической оценки

Инвестиционный проект. Понятие, классификация и особенности. Содержание инвестиционного проекта. Жизненный цикл инвестиционного проекта. Фазы (стадии) развития инвестиционного проекта. Их характеристика.

### Тема 2. Инвестиционный анализ (теория выбора)

Простые и сложные методы. Дисконтирование. Критерии инвестиционного анализа.

### Тема 3. Методы оптимального размещения реальных инвестиций.

Цели и задачи портфельного инвестирования. Методы оптимального размещения реальных инвестиций. Пространственная оптимизация. Временная оптимизация.

## 3. Перечень учебно-методического обеспечения дисциплины (модуля)

- мультимедийные презентационные материалы по дисциплине (модулю) представлены в электронном курсе в ЭИОС МГТУ;
- методические указания к выполнению практических работ представлены в электронном курсе в ЭИОС МГТУ;
- методические материалы для обучающихся по освоению дисциплины (модуля) представлены на официальном сайте МГТУ в разделе «Информация по образовательным программам, в том числе адаптированным».

#### **4. Фонд оценочных средств по дисциплине (модулю)**

Является отдельным компонентом образовательной программы, разработан в форме отдельного документа, включает в себя:

- перечень компетенций с указанием этапов их формирования в процессе освоения дисциплины (модуля);
- задания текущего контроля;
- задания промежуточной аттестации;
- задания внутренней оценки качества образования.

**5. Перечень основной и дополнительной учебной литературы** (печатные издания, электронные учебные издания и (или) ресурсы электронно-библиотечных систем)

#### *Основная литература:*

1. Мазур, И. И. Управление проектами : учеб. пособие для вузов / И. И. Мазур, В. Д. Шапиро, Н. Г. Ольдерогге; под общ. ред. И. И. Мазура. - 2-е изд. - Москва : Омега-Л, 2004. - 664 с. (37 экз.)
2. Колтынюк, Б. А. Инвестиционные проекты : учеб. для вузов / Б. А. Колтынюк. - 2-е изд., перераб. и доп. - Санкт-Петербург : Изд-во Михайлова В. А., 2002. - 622 с. (30 экз.)

#### *Дополнительная литература:*

1. Заренков, В. А. Управление проектами : учеб. пособие для строит. вузов / В. А. Заренков. - 2-е изд. - Москва : АСВ, 2006 ; Санкт-Петербург : СПбГАСУ, 2006. – 310 с. (7 экз.)
2. Попов, Ю. И. Управление проектами : учеб. пособие [для вузов] / Ю. И. Попов, О. В. Яковенко; Ин-т экономики и финансов "Синергия". - Москва : Инфра-М, 2008. – 207 с. (3 экз.)
3. Романова, М. В. Управление проектами : учеб. пособие для вузов / М. В. Романова. - Москва : Форум : Инфра-М, 2013. - 253 с. (3 экз.)

#### **6. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы**

1. Электронный каталог библиотеки МГТУ с возможностью ознакомиться с печатным вариантом издания в читальных залах библиотеки – <http://lib.mstu.edu.ru/MegaPro/Web>.
2. Государственная система правовой информации – официальный интернет-портал правовой информации – URL: <http://pravo.gov.ru>
3. Справочно-правовая система. Консультант Плюс – URL: <http://www.consultant.ru/>

**7. Перечень лицензионного и свободно распространяемого программного обеспечения, в том числе отечественного производства**

1. Операционная система Microsoft Windows 7 Professional
2. Офисный пакет Microsoft Office 2010
3. Операционная система Microsoft Windows XP Professional

4. Офисный пакет Microsoft Office 2007

### 8. Обеспечение освоения дисциплины лиц с инвалидностью и ОВЗ

Обучающиеся из числа инвалидов и лиц с ОВЗ обеспечиваются печатными и (или) электронными образовательными ресурсами в формах, адаптированных к ограничениям их здоровья.

**9. Материально-техническое обеспечение дисциплины (модуля)** представлено в приложении к ОПОП «Материально-технические условия реализации образовательной программы» и включает:

– учебные аудитории для проведения учебных занятий, предусмотренных программой магистратуры, оснащенные оборудованием и техническими средствами обучения;

– помещения для самостоятельной работы обучающихся, оснащенные компьютерной техникой с возможностью подключения к сети «Интернет» и обеспечением доступа к электронной информационно-образовательной среде МГТУ.

Допускается замена оборудования его виртуальными аналогами.

### 10. Распределение трудоемкости по видам учебной деятельности

Таблица 1 – Распределение трудоемкости

Вид учебной деятельности	Распределение трудоемкости дисциплины (модуля) по формам обучения										
	Очная				Очно-заочная				Заочная		
	Семестр			Всего часов	Семестр			Всего часов	Семестр/Курс		Всего часов
	3				4						
Лекции	6			6	6			6			
Практические занятия	12			12	10			10			
Лабораторные работы	–			–	–			–			
Самостоятельная работа	54			54	56			56			
Подготовка к промежуточной аттестации	–			–	–			–			
<b>Всего часов по дисциплине</b>	<b>72</b>			<b>72</b>	<b>72</b>			<b>72</b>			
/ из них в форме практической подготовки											

Формы промежуточной аттестации и текущего контроля

Экзамен	–			–	–			–			
Зачет	+			+	+			+			
Курсовая работа	–			–	–			–			
Количество расчетно-графических работ	–			–	–			–			
Количество контрольных работ	–			–	–			–			
Количество рефератов	–			–	–			–			
Количество эссе	–			–	–			–			

## Перечень практических занятий по формам обучения

№ п/п	Темы практических занятий
1	2
<b>Очная форма</b>	
1	Портфельный подход в управлении инвестиционной деятельностью организации. <i>Доклад</i>
2	Российский и зарубежный опыт портфельного управления. <i>Доклад</i>
3	Методы инвестиционного анализа. <i>Практическая работа.</i>
4	Портфель реальных инвестиций. <i>Практическая работа.</i>
<b>Очно-заочная форма</b>	
1	Портфельный подход в управлении инвестиционной деятельностью организации. <i>Доклад</i>
2	Российский и зарубежный опыт портфельного управления. <i>Доклад</i>
3	Методы инвестиционного анализа. <i>Практическая работа.</i>
4	Портфель реальных инвестиций. <i>Практическая работа.</i>