

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

доцент

должность

К.Э.Н., доцент

ученая степень, звание

Утверждено на заседании кафедры

экономики и управления

наименование кафедры

протокол № 8 от

21.03.2024

Заведующий кафедрой

ЭиУ

Щебарова Н.Н.

ФИО

подпись

Мурманск

2024

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 _{ПК-4} : - 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 _{ПК-4} : - составляет инвестиционный портфель ИД-3 _{ПК-4} : - 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	Знать: - понятие инвестиционного портфеля, его виды; - методы управления портфелем реальных инвестиций; - методы оценки эффективности вложений в инвестиционный портфель с учетом риска. Уметь: - применять методы портфельного анализа для обеспечения требуемого уровня доходности; - оценивать доходность портфеля реальных инвестиций. Владеть: - 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 МАУ;

- методические указания к выполнению практических работ представлены в электронном курсе в ЭИОС МАУ;

- методические материалы для обучающихся по освоению дисциплины (модуля) представлены на официальном сайте МАУ 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. Блау, С. Л. Инвестиционный анализ : учебник / С. Л. Блау. – 6-е изд. – Москва : Дашков и К°, 2023. – 256 с. : табл. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=710001>. – Библиогр.: с. 234-235. – ISBN 978-5-394-05218-7. – Текст : электронный.

2. Мухачева, А. В. Инвестиционный анализ : учебное пособие : [16+] / А. В. Мухачева, А. О. Акулов ; Кемеровский государственный университет. – Кемерово : Кемеровский государственный университет, 2022. – 186 с. : ил. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=700754> – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-8353-2949-6. – Текст : электронный.

Дополнительная литература:

1. Алиев, А. Т. Управление инвестиционным портфелем : учебное пособие : [16+] / А. Т. Алиев, К. В. Сомик. – 4-е изд., стер. – Москва : Дашков и К°, 2021. – 159 с. : ил., табл., граф. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=621618> – Библиогр.: с. 111-112. – ISBN 978-5-394-04373-4. – Текст : электронный.

2. Балдин, К. В. Управление инвестициями : учебник / К. В. Балдин, Е. Л. Макриденко, О. И. Швайка ; под общ. ред. К. В. Балдина. – 4-е изд., стер. – Москва : Дашков и К°, 2022. – 238 с. : ил., табл. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=684459> – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-04617-9. – Текст : электронный.

6. Профессиональные базы данных и информационные справочные системы

1. Электронный каталог библиотеки МАУ 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 2010

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 МАУ.

Допускается замена оборудования его виртуальными аналогами.

10. Распределение трудоемкости по видам учебной деятельности

Таблица 1 – Распределение трудоемкости

Таблица 1. Распределение трудоемкости												
Вид учебной деятельности	Распределение трудоемкости дисциплины (модуля) по формам обучения											
	Очная				Очно-заочная				Заочная			
	Семестр			Всего часов	Семестр			Всего часов	Курс/Сессия			Всего часов
									2/3			
Лекции									2			2
Практические занятия									2			2
Лабораторные работы									–			–
Самостоятельная работа									64			64
Подготовка к промежуточной аттестации									4			4
Всего часов по дисциплине									72			72
/ 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
Заочная форма	
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>