

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение высшего образования «Тамбовский государственный университет имени Г.Р. Державина»
Институт креативных индустрий, экономики и предпринимательства
Кафедра стратегического развития экономики

УТВЕРЖДАЮ:
И.о. директора института



Т. М. Кожевникова
«16» сентября 2024 г.

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА

по дисциплине Б1.В.13 Моделирование целевого портфеля

Направление подготовки/специальность: 38.04.01 - Экономика

Профиль/направленность/специализация: Финансовая и управленческая
бизнес-аналитика

Уровень высшего образования: магистратура

Квалификация: Магистр

год набора: 2024

Тамбов, 2024

Автор программы:

Кандидат экономических наук, доцент Мананникова Оксана Николаевна

Рабочая программа составлена в соответствии с ФГОС ВО по направлению подготовки 38.04.01 - Экономика (уровень магистратуры) (приказ Министерства науки и высшего образования РФ от «11» августа 2020 г. № 939).

Рабочая программа принята на заседании Кафедры стратегического развития экономики «13» сентября 2024 г. Протокол № 2

Рассмотрена и одобрена на заседании Ученого совета Института креативных индустрий, экономики и предпринимательства, Протокол от «16» сентября 2024 г. № 1.

СОДЕРЖАНИЕ

1. Цели и задачи дисциплины.....	4
2. Место дисциплины в структуре ОП Магистратуры.....	5
3. Объем и содержание дисциплины.....	5
4. Контроль знаний обучающихся и типовые оценочные средства.....	13
5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля).....	20
6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины.....	22
7. Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы.....	24

1. Цели и задачи дисциплины

1.1 Цель дисциплины – формирование компетенций:

ПК-5 Способность осуществлять моделирование целевого портфеля клиента в зависимости от целей, риска, доходности, а также проводить его оптимизацию на основе регулярной оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования

1.2 Типы задач профессиональной деятельности, к которым готовятся обучающиеся в рамках освоения дисциплины:

- проектно-экономический

1.3 Дисциплина ориентирована на подготовку обучающихся к профессиональной деятельности в сфере: 08 Финансы и экономика (в сферах: исследований, анализа и прогнозирования социально-экономических процессов и явлений на микроуровне и макроуровне в экспертно-аналитических службах (центрах экономического анализа, правительственном секторе, общественных организациях); производства продукции и услуг, включая анализ спроса на продукцию и услуги, и оценку их текущего и перспективного предложения, продвижение продукции и услуг на рынок, планирование и обслуживание финансовых потоков, связанных с производственной деятельностью; кредитования; страхования, включая пенсионное и социальное; операций на финансовых рынках, включая управление финансовыми рисками; внутреннего и внешнего финансового контроля и аудита, финансового консультирования; консалтинга)

1.4 В результате освоения дисциплины у обучающихся должны быть сформированы:

Обобщенные трудовые функции / трудовые функции / трудовые или профессиональные действия (при наличии профстандарта)	Код и наименование компетенции ФГОС ВО, необходимой для формирования трудового или профессионального действия	Индикаторы достижения компетенций
	ПК-5 Способность осуществлять моделирование целевого портфеля клиента в зависимости от целей, риска, доходности, а также проводить его оптимизацию на основе регулярной оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования	Осуществляет выбор оптимальной модели целевого инвестиционного портфеля с учетом уровня целевой доходности и риска, а также его оптимизацию на основе регулярной оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования

1.5 Согласование междисциплинарных связей дисциплин, обеспечивающих освоение компетенций:

ПК-5 Способность осуществлять моделирование целевого портфеля клиента в зависимости от целей, риска, доходности, а также проводить его оптимизацию на основе регулярной оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования

№ п/п	Наименование дисциплин, определяющих междисциплинарные связи	Форма обучения			
		Очная (семестр)			
		1	2	3	4
1	Анализ финансового рынка	+			

2	Ознакомительная практика		+		
3	Практика по профилю профессиональной деятельности			+	+

2. Место дисциплины в структуре ОП магистратуры:

Дисциплина «Моделирование целевого портфеля» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений, учебного плана ОП по направлению подготовки 38.04.01 - Экономика.

Дисциплина «Моделирование целевого портфеля» изучается в 3 семестре.

3. Объем и содержание дисциплины

3.1. Объем дисциплины: 2 з.е.

Очная: 2 з.е.

Вид учебной работы	Очная (всего часов)
Общая трудоёмкость дисциплины	72
Контактная работа	24
Лекции (Лекции)	12
Практические (Практ. раб.)	12
Самостоятельная работа (СР)	48
Зачет	-

3.2. Содержание курса:

№ темы	Название раздела/темы	Вид учебной работы, час.			Формы текущего контроля
		Лек ции	Пра кт. раб.	СР	
		О	О	О	
3 семестр					
1	Принципы формирования типов инвестиционных портфелей в зависимости от длительности инвестирования, рискованности, вовлеченности в управление.	2	2	6	Собеседование

2	Риски портфельного инвестирования и способы их оценки. Агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный портфели.	2	2	12	Собеседование; Тестирование
3	Инвестиционные стратегии и управление портфелем	4	4	12	Собеседование
4	Портфель цифровых активов	2	2	12	Собеседование; Тестирование
5	Подходы к моделированию целевого портфеля клиента.	2	2	6	Собеседование

**Тема 1. Принципы формирования типов инвестиционных портфелей в зависимости от длительности инвестирования, рискованности, вовлеченности в управление.
(ПК-5)**

Лекция.

Определение инвестиционного портфеля и его роль в финансовом планировании. Основные цели и принципы формирования инвестиционных портфелей. Длительность инвестирования как фактор формирования портфеля. Рассмотрение влияния длительности инвестиционного горизонта на выбор инвестиционных инструментов и стратегий. Анализ основных подходов к формированию инвестиционного портфеля в зависимости от целевого срока инвестирования. Рискованность как фактор формирования портфеля. Обсуждение концепции риска и его роли в инвестиционном процессе. Анализ различных видов риска и методов его оценки. Изучение стратегий диверсификации и аллокации активов для управления рисками. Вовлеченность в управление как фактор формирования портфеля. Рассмотрение различных уровней вовлеченности инвестора в управление портфелем: активное, пассивное и полупассивное управление. Обсуждение преимуществ и недостатков каждого подхода к управлению портфелем. Анализ инвестиционных инструментов и стратегий, соответствующих разным уровням вовлеченности в управление. Практические аспекты формирования инвестиционных портфелей. Изучение практических методов оценки эффективности портфеля, таких как оценка доходности, риска и диверсификации. Обсуждение стратегий перебалансировки портфеля и принципов управления его составом в течение времени. Примеры формирования типов инвестиционных портфелей. Анализ конкретных примеров портфелей с разными целями, сроками инвестирования и уровнями риска. Рассмотрение успешных стратегий формирования портфелей в различных инвестиционных условиях и рыночных ситуациях.

Практическое занятие.

Какие основные факторы следует учитывать при формировании инвестиционного портфеля в зависимости от его длительности инвестирования?

Какой подход к формированию портфеля рекомендуется для инвесторов с долгосрочным инвестиционным горизонтом, и почему?

Как можно оценить уровень риска инвестиционного портфеля, и какие методы могут быть использованы для его управления?

Какие принципы диверсификации активов могут помочь снизить риск в инвестиционном портфеле?

В чем состоит разница между активным, пассивным и полупассивным управлением инвестиционным портфелем?

Какие инструменты и стратегии могут быть использованы для управления инвестиционным портфелем в соответствии с его уровнем вовлеченности в управление?

Какие примеры успешных стратегий формирования инвестиционных портфелей вы можете привести, учитывая разные цели, сроки инвестирования и уровни риска?

Темы рефератов и сообщений:

"Долгосрочное инвестирование: стратегии формирования портфеля и оптимизация доходности".

"Управление риском в инвестиционном портфеле: методы оценки, диверсификация и защита от потерь".

"Активное и пассивное управление инвестиционными портфелями: сравнительный анализ подходов и их эффективность".

"Роль диверсификации активов в управлении инвестиционным портфелем: стратегии и принципы формирования".

"Инвестиционные стратегии для инвесторов с разным уровнем вовлеченности в управление портфелем: от самостоятельного до профессионального управления".

"Факторы риска и доходности в формировании инвестиционного портфеля: анализ влияния на выбор инвестиционных инструментов и стратегий".

"Инновационные подходы к формированию инвестиционных портфелей: роль технологий и алгоритмического трейдинга в оптимизации инвестиционных решений".

Задания для самостоятельной работы.

Сравнительный анализ портфелей различной длительности инвестирования. Составьте три инвестиционных портфеля с разным сроком инвестирования (краткосрочный, среднесрочный, долгосрочный) и обоснуйте выбор активов для каждого из них с учетом их целей, рисков и ожидаемой доходности.

Оценка риска и диверсификация портфеля. Проведите анализ риска для вашего инвестиционного портфеля и предложите стратегии диверсификации для снижения риска. Объясните, как выбор различных активов и их корреляций может повлиять на общий уровень риска портфеля.

Управление инвестиционным портфелем с разной степенью вовлеченности. Разработайте план управления инвестиционным портфелем для трех типов инвесторов: активного, пассивного и полупассивного. Опишите стратегии, которые каждый из них может использовать для максимизации доходности и управления рисками в рамках своего уровня вовлеченности.

Тема 2. Риски портфельного инвестирования и способы их оценки. Агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный портфели. (ПК-5)

Лекция.

Определение портфельного инвестирования и его роль в достижении финансовых целей. Обзор основных принципов и стратегий портфельного инвестирования. Риски в портфельном инвестировании. Рассмотрение основных типов рисков, связанных с инвестированием: рыночный риск, кредитный риск, инфляционный риск и др. Анализ причин возникновения рисков в портфельном инвестировании и их влияния на результаты. Способы оценки рисков в портфельном инвестировании. Обзор методов оценки рисков, таких как стандартное отклонение, бета-коэффициент, Value at Risk (VaR) и др. Изучение преимуществ и ограничений каждого метода оценки риска. Типы портфелей в зависимости от степени риска. Представление концепций агрессивного, умеренного, консервативного и сбалансированного портфелей. Анализ особенностей каждого типа портфеля, его состава и целей. Стратегии формирования и управления портфелем. Разработка стратегий формирования портфеля в зависимости от инвестиционного горизонта, целей и уровня риска. Изучение методов управления портфелем, включая ребалансировку, диверсификацию и использование инвестиционных фондов. Практические аспекты оценки и управления рисками в портфельном инвестировании. Примеры оценки рисков и построения портфелей разного типа с использованием реальных данных. Рекомендации по выбору подходящего типа портфеля в зависимости от инвестиционных целей и рискованности.

Практическое занятие.

Вопросы для семинарского занятия:

Какие основные виды рисков могут возникать при портфельном инвестировании, и как они могут повлиять на инвестиционные результаты?

Какие методы оценки рисков в портфельном инвестировании вы знаете, и как они используются для измерения риска портфеля?

В чем заключается различие между агрессивным, умеренным, консервативным и сбалансированным портфелями, и какие типы инвесторов могут предпочесть каждый из них?

Какие стратегии управления рисками могут быть применены при построении агрессивного портфеля, а какие - для консервативного?

Какие преимущества и недостатки имеют различные типы портфелей с точки зрения риска и ожидаемой доходности?

Темы рефератов и сообщений:

"Оценка рисков в портфельном инвестировании: методы и подходы".

"Типы портфелей и их характеристики: агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный".

"Стратегии управления рисками в различных типах портфелей".

"Агрессивный портфель: особенности формирования, риски и потенциальная доходность".

"Умеренный портфель: стратегии диверсификации и балансировки рисков".

"Консервативный портфель: выбор активов и минимизация рисков".

"Сбалансированный портфель: преимущества и недостатки в условиях изменяющихся рыночных условий".

Задания для самостоятельной работы.

Сравнительный анализ рисков различных типов портфелей. Сформируйте по одному агрессивному, умеренному, консервативному и сбалансированному портфелю, используя разные активы (акции, облигации, денежные средства и др.). Оцените риски каждого портфеля с помощью выбранных методов оценки рисков.

Разработка стратегии управления рисками в портфельном инвестировании. Выберите один из типов портфелей (например, агрессивный) и разработайте стратегию управления его рисками. Ваша стратегия должна включать в себя методы диверсификации, ребалансировки и другие инструменты управления рисками.

Проектирование сбалансированного портфеля. Составьте сбалансированный портфель, который бы сочетал в себе элементы агрессивного, умеренного и консервативного подходов. Обоснуйте выбор каждого актива в портфеле и объясните, как эта комбинация помогает снизить риски при сохранении приемлемого уровня доходности.

Тема 3. Инвестиционные стратегии и управление портфелем (ПК-5)

Лекция.

Определение инвестиционных стратегий и их роль в достижении инвестиционных целей. Обзор основных принципов управления портфелем и его значения для инвесторов. Типы инвестиционных стратегий. Рассмотрение различных типов инвестиционных стратегий: активное и пассивное инвестирование, стратегии роста и доходности, стратегии стоимости и т.д. Анализ особенностей каждой стратегии, ее целей, рисков и ожидаемой доходности. Принципы формирования инвестиционного портфеля. Обзор основных принципов формирования инвестиционного портфеля: диверсификация, балансировка, адаптация к рыночным условиям и др. Изучение важности выбора подходящего соотношения активов и стратегий в портфеле. Управление рисками в инвестиционном портфеле. Разработка стратегий управления рисками: минимизация рисков, оптимизация доходности, защита от неблагоприятных событий на рынке. Изучение инструментов и методов управления рисками, таких как диверсификация, хеджирование и использование производных финансовых инструментов. Процесс управления портфелем. Шаги и этапы управления портфелем: анализ целей инвестирования, выбор стратегии, формирование портфеля, ребалансировка и мониторинг. Практические аспекты управления портфелем и взаимодействие с рынком и инвестиционными инструментами. Технологические инновации и инвестиционное управление. Роль технологических инноваций в управлении портфелем: автоматизация, алгоритмическая торговля, использование больших данных и искусственного интеллекта. Оценка преимуществ и вызовов использования технологических инноваций в инвестиционном управлении.

Практическое занятие.

Вопросы для семинарского занятия:

Какие основные типы инвестиционных стратегий вы знаете, и как они отличаются друг от друга?

Какие факторы следует учитывать при выборе инвестиционной стратегии для конкретного инвестора?

Какова роль диверсификации в управлении портфелем, и какие преимущества она может предоставить?

Какие методы используются для оценки рисков и доходности инвестиционного портфеля?

Какие основные шаги включает в себя процесс управления портфелем, начиная с анализа целей и заканчивая ребалансировкой?

Какова роль технологических инноваций, таких как алгоритмическая торговля и искусственный интеллект, в современном управлении портфелем?

Каковы преимущества использования пассивных стратегий (например, инвестирование в индексные фонды) по сравнению с активными стратегиями управления портфелем?

Темы рефератов и сообщений:

"Основные типы инвестиционных стратегий: сравнительный анализ и применение в современной практике".

"Роль диверсификации в управлении инвестиционным портфелем: стратегии, методы и практические рекомендации".

"Активное и пассивное инвестирование: сравнительный анализ эффективности и преимущества для инвесторов".

"Оценка рисков и доходности в инвестиционном портфеле: методы, инструменты и практическое применение".

"Инновации в управлении портфелем: роль технологий, алгоритмическая торговля и использование больших данных".

"Формирование и оптимизация инвестиционного портфеля: стратегии, принципы и инструменты".

"Управление портфелем в условиях изменяющихся рыночных условий: стратегии адаптации и мониторинга".

Задания для самостоятельной работы.

Сравнительный анализ инвестиционных стратегий: выберите несколько известных инвестиционных стратегий (например, активное управление, индексное инвестирование, стратегия стоимости и др.) и проведите исследование их основных принципов, преимуществ и недостатков. Напишите обзорный доклад, в котором сравните выбранные стратегии и определите их подходящее применение в различных ситуациях.

Формирование инвестиционного портфеля: разработайте собственную стратегию построения инвестиционного портфеля, учитывая ваш инвестиционный горизонт, рисковый профиль и цели. Составьте план действий, определите ассет-аллокацию и выберите инвестиционные инструменты в соответствии с вашей стратегией.

Анализ рисков и доходности в портфеле: выберите несколько методов оценки рисков и доходности в инвестиционном портфеле (например, VAR, CAPM, Sharpe ratio) и примените их для оценки вашего собственного портфеля или портфеля, составленного на основе предоставленных данных. Оцените эффективность выбранных методов и сделайте выводы о степени риска и доходности вашего портфеля.

Тема 4. Портфель цифровых активов (ПК-5)

Лекция.

Введение в портфель цифровых активов. Определение цифровых активов и их роль в современной экономике. Обзор основных категорий цифровых активов: криптовалюты, токены, цифровые ценности и др. Типы цифровых активов. Рассмотрение различных типов цифровых активов: криптовалюты (например, Биткоин, Эфириум), токенизированные активы (security tokens, utility tokens), цифровые коллекции (NFT) и др. Анализ особенностей каждого типа цифровых активов, их преимуществ и рисков. Преимущества инвестирования в портфель цифровых активов. Изучение основных преимуществ цифровых активов: высокая ликвидность, доступность, диверсификация, низкие транзакционные издержки и др. Обсуждение роли цифровых активов в диверсификации инвестиционного портфеля. Риски и вызовы инвестирования в портфель цифровых активов. Идентификация основных рисков цифровых активов: волатильность, регуляторные риски, кибербезопасность, ликвидность и др. Рассмотрение вызовов, связанных с инвестированием в цифровые активы, и методов их смягчения. Стратегии управления портфелем цифровых активов. Обзор основных стратегий управления портфелем цифровых активов: активное управление, пассивное управление, стратегии хеджирования и др. Рекомендации по выбору подходящей стратегии управления в зависимости от инвестиционных целей и рискового профиля инвестора. Развитие и перспективы рынка цифровых активов. Анализ текущего состояния рынка цифровых активов и его динамики. Прогнозирование будущего развития и перспективы рынка цифровых активов в контексте технологических инноваций и регуляторных изменений.

Практическое занятие.

Вопросы для семинарского занятия:

Какие основные категории цифровых активов вы бы выделили в своем инвестиционном портфеле, и почему?

Какие факторы следует учитывать при выборе цифровых активов для инвестирования?

Какие риски связаны с инвестированием в портфель цифровых активов, и как их можно смягчить?

Каковы преимущества диверсификации портфеля цифровых активов, и какой подход к диверсификации вы предпочитаете?

Какие инвестиционные стратегии могут быть эффективны при управлении портфелем цифровых активов, и как выбрать подходящую стратегию в зависимости от инвестиционных целей?

Темы рефератов и сообщений:

"Типы цифровых активов и их особенности: анализ криптовалют, токенов и цифровых коллекций".

"Преимущества и риски инвестирования в портфель цифровых активов: сравнительный анализ".

"Стратегии формирования инвестиционного портфеля цифровых активов: подходы к диверсификации и управлению рисками".

"Регуляторные аспекты инвестирования в цифровые активы: существующие нормативные требования и перспективы регулирования".

"Технологические инновации и развитие рынка цифровых активов: влияние на инвестиционные стратегии и перспективы роста".

"Психологические аспекты инвестирования в цифровые активы: роль трейдинговых стратегий и эмоционального инвестирования".

"Будущее рынка цифровых активов: прогнозирование трендов и перспективы развития в контексте глобальных изменений".

Задания для самостоятельной работы.

Составьте собственный инвестиционный портфель цифровых активов, включая криптовалюты, токены и цифровые коллекции. Обоснуйте свой выбор активов, учитывая их потенциальную доходность, риски и диверсификацию.

Проведите анализ рисков и доходности различных портфелей цифровых активов, сравнивая активные стратегии управления с пассивными подходами, такими как инвестирование в индексные фонды криптовалют. Оцените эффективность различных стратегий и сделайте выводы о их преимуществах и недостатках.

Исследуйте влияние технологических инноваций на развитие рынка цифровых активов. Выполните анализ последних технологических тенденций, таких как децентрализованные финансы (DeFi), цифровые искусственные интеллекты (AI), и определите их потенциал для роста и влияние на инвестиционные стратегии.

Тема 5. Подходы к моделированию целевого портфеля клиента. (ПК-5)

Лекция.

Введение в моделирование целевого портфеля. Определение понятия целевого портфеля клиента. Значение моделирования целевого портфеля в финансовом планировании. Основные подходы к моделированию целевого портфеля. Статический подход: анализ финансовых целей клиента и разработка портфеля на основе его текущих потребностей и рискованного профиля. Динамический подход: учет изменяющихся факторов, таких как доходы, расходы, цели и сроки инвестирования, в процессе формирования портфеля. Основные этапы моделирования целевого портфеля. Сбор информации о клиенте: доходы, расходы, инвестиционные цели, рискотерпимость и т. д. Определение инвестиционной стратегии: выбор активов и их распределение в портфеле в соответствии с целями и рисками клиента. Оценка эффективности портфеля: анализ ожидаемой доходности, волатильности, корреляции и других показателей для достижения целей клиента. Инструменты моделирования целевого портфеля. Финансовое моделирование: использование математических моделей для прогнозирования доходности и риска портфеля. Использование программного обеспечения и онлайн-платформ для анализа и построения портфелей. Экспертные системы и робо-советники для автоматизации процесса принятия инвестиционных решений. Практические аспекты моделирования целевого портфеля. Примеры расчета и анализа целевых портфелей на основе реальных данных клиентов. Разработка индивидуализированных стратегий инвестирования в зависимости от потребностей и целей каждого клиента. Учет изменчивости рыночных условий и корректировка целевого портфеля. Стратегии ребалансирования портфеля в ответ на изменения финансовых целей, рискованного профиля и рыночных условий. Роль регулярного мониторинга и адаптации целевого портфеля к изменяющимся обстоятельствам.

Практическое занятие.

Вопросы для семинарского занятия:

Какие основные подходы используются при моделировании целевого портфеля клиента?

Какие этапы включает в себя процесс моделирования целевого портфеля?

Какие инструменты и методы могут быть применены при моделировании целевого портфеля?

Какие факторы следует учитывать при выборе инвестиционной стратегии для целевого портфеля клиента?

Каким образом можно адаптировать целевой портфель к изменяющимся финансовым условиям и потребностям клиента?

Темы рефератов и сообщений:

Сравнительный анализ статического и динамического подходов к моделированию целевого портфеля клиента.

Инструменты и методы моделирования целевого портфеля: от программного обеспечения до экспертных систем.

Роль финансового консультанта в процессе моделирования целевого портфеля клиента.

Адаптивные стратегии моделирования целевого портфеля в условиях изменяющейся экономической среды.

Влияние рискованного профиля клиента на выбор инвестиционной стратегии при моделировании целевого портфеля.

Практические аспекты моделирования целевого портфеля: анализ данных, расчеты, оценка эффективности.

Оценка эффективности моделирования целевого портфеля и его роль в достижении финансовых целей клиента.

Задания для самостоятельной работы.

Исследование различных методов моделирования целевого портфеля клиента. Сравните статический и динамический подходы, определите их основные преимущества и недостатки.

Анализ существующих инструментов для моделирования целевого портфеля. Изучите программное обеспечение и онлайн-платформы, предназначенные для создания и анализа портфелей. Выявите их основные характеристики и возможности.

Разработка инвестиционной стратегии для целевого портфеля клиента. Проведите собственное исследование и предложите инвестиционную стратегию, учитывающую цели, риски и предпочтения клиента. Обоснуйте выбор активов и их распределение в портфеле.

4. Контроль знаний обучающихся и типовые оценочные средства

4.1. Распределение баллов:

3 семестр

- текущий контроль – 80 баллов
- контрольные срезы – 2 среза по 10 баллов каждый
- премиальные баллы – 20 баллов

Распределение баллов по заданиям:

№ те мы	Название темы / вид учебной работы	Формы текущего контроля / срезы	Мах. кол-во баллов	Методика проведения занятия и оценки
1.	Принципы формирования типов инвестиционных портфелей в зависимости от длительности инвестирования, рискованности, вовлеченности в управление.	Собеседование	20	<p>Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.</p> <p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный.</p> <p>20-10 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>5-8 баллов – студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>1-4 балла – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, но затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>

2.	Риски портфельного инвестирования и способы их оценки. Агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный портфели.	Собеседование	10	<p>Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.</p> <p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный.</p> <p>9-10 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>5-8 баллов – студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>1-4 балла – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, но затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
		Тестирование(контрольный срез)	10	<p>10 баллов – студент правильно отвечает на 75-100% вопросов в тесте</p> <p>7 баллов – студент правильно отвечает на 50-74% вопросов в тесте</p> <p>3 балла – студент правильно отвечает на 25-50% вопросов в тесте.</p> <p>Менее 25% правильных ответов баллов не дает</p>
3.	Инвестиционные стратегии и управление портфелем	Собеседование	10	<p>Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.</p> <p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный.</p> <p>9-10 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>5-8 баллов – студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>1-4 балла – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, но затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>

4.	Портфель цифровых активов	Собеседование	20	<p>Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.</p> <p>Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный.</p> <p>10-14 баллов – студент умеет сопоставить полученную при подготовке к практическому занятию информацию, сравнивать разные точки зрения на анализируемую проблему, уметь четко формулировать свои вопросы и отвечать на задаваемые ему вопросы, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии</p> <p>13-9 баллов – студент умеет применять полученную при подготовке к практическому занятию информацию, отвечать на большинство вопросов, вести дискуссию с использованием профессиональной терминологии.</p> <p>8-1 балла – студент владеет теоретическим материалом по теме практического занятия, но затрудняется при ответе на вопросы, не умеет сформулировать свою точку зрения на обсуждаемую проблему</p> <p>Если студент не владеет проблематикой практического занятия, не может отвечать на вопросы, зачитывает ответ по напечатанному тексту – ответ баллами не оценивается.</p>
		Тестирование(контрольный срез)	10	<p>Тест состоит из вопросов по заданной теме.</p> <p>8-10 баллов – студент правильно отвечает на 75-100% вопросов в тесте</p> <p>5-7 баллов – студент правильно отвечает на 50-74% вопросов в тесте</p> <p>1-4 балла – студент правильно отвечает на 25-50% вопросов в тесте.</p> <p>Менее 25% правильных ответов баллов не дает</p>
5.	Подходы к моделированию целевого портфеля клиента.	Собеседование	20	<p>20-10 баллов – изложение материала логично, грамотно, без ошибок; свободное владение профессиональной терминологией; умение высказывать и обосновать свои суждения; студент дает четкий, полный, правильный ответ на теоретические вопросы; студент организует связь теории с практикой</p> <p>9-4 баллов – студент грамотно излагает материал; ориентируется в материале, владеет профессиональной терминологией, осознанно применяет теоретические знания, но содержание и форма ответа имеют отдельные неточности; ответ правильный, полный, с незначительными неточностями или недостаточно полный</p> <p>3-1 баллов – студент излагает материал неполно, непоследовательно, допускает неточности в определении понятий, не может доказательно обосновать свои суждения; обнаруживается недостаточно глубокое понимание изученного материала.</p> <p>Если у студента отсутствуют необходимые теоретические знания; допущены ошибки в определении понятий, искажен их смысл – не оценивается баллами.</p>

6.	Премияльные баллы	20	Дополнительные премиальные баллы могут быть начислены: - постоянная активность во время практических занятий – 10 баллов; - полностью подготовленная к публикации статья по тематике в рамках дисциплины – 10 баллов; - публикация статьи по тематике изучаемой дисциплины в сборнике студенческих работ / материалах международной, всероссийской конференции / журнале из перечня ВАК – 10 / 15 / 20
7.	Индивидуальные задания, с помощью которых можно набрать дополнительные баллы	70	Добор: студент может предоставить все задания текущего контроля и контрольные срезы
8.	Итого за семестр	100	

Итоговая оценка по зачету выставляется в 100-балльной шкале и в традиционной четырехбалльной шкале. Перевод 100-балльной рейтинговой оценки по дисциплине в традиционную четырехбалльную осуществляется следующим образом:

100-балльная система	Традиционная система
50 - 100 баллов	Зачтено
0 - 49 баллов	Не зачтено

4.2 Типовые оценочные средства текущего контроля

Собеседование

Тема 1. Принципы формирования типов инвестиционных портфелей в зависимости от длительности инвестирования, рискованности, вовлеченности в управление.

Какие факторы необходимо учитывать при формировании инвестиционного портфеля в зависимости от его длительности инвестирования?

Какие принципы диверсификации активов помогают снизить риск в инвестиционном портфеле?

Как различается подход к формированию портфеля для инвесторов с разным уровнем риска?

В чем состоит различие между активным, пассивным и полупассивным управлением инвестиционным портфелем?

Какие факторы могут влиять на выбор инвестиционных стратегий и инструментов в зависимости от уровня вовлеченности инвестора в управление портфелем?

Тема 2. Риски портфельного инвестирования и способы их оценки. Агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный портфели.

Какие основные виды рисков существуют в портфельном инвестировании, и как они могут быть классифицированы?

Какие методы используются для оценки рисков в портфельном инвестировании, и в чем заключаются особенности каждого метода?

Чем отличаются агрессивный, умеренный, консервативный и сбалансированный портфели? Какие инвесторы предпочитают каждый из них?

Какие стратегии управления рисками могут быть применены в каждом типе портфеля?

Какие преимущества и недостатки имеют разные типы портфелей с точки зрения риска и ожидаемой доходности?

Тема 3. Инвестиционные стратегии и управление портфелем

Какие основные виды инвестиционных стратегий существуют, и как они отличаются друг от друга?

Что такое диверсификация портфеля, и какие преимущества она может предоставить инвестору?

Какие методы используются для оценки рисков и доходности инвестиционного портфеля?

В чем различия между активным и пассивным инвестированием, и какие особенности каждого подхода?

Какие факторы следует учитывать при выборе стратегии управления портфелем в зависимости от инвестиционных целей и рискованного профиля инвестора?

Тема 4. Портфель цифровых активов

Какие основные категории цифровых активов существуют, и как они отличаются друг от друга?

Какие преимущества и риски связаны с инвестированием в портфель цифровых активов по сравнению с традиционными активами?

Какие стратегии управления портфелем цифровых активов существуют, и как выбрать подходящую стратегию в зависимости от инвестиционных целей?

Какие технологические инновации оказывают наибольшее влияние на рынок цифровых активов, и как это отражается на инвестиционных стратегиях?

Какие факторы следует учитывать при оценке рисков и доходности портфеля цифровых активов, и как проводится диверсификация для снижения рисков?

Тема 5. Подходы к моделированию целевого портфеля клиента.

Какие основные подходы используются при моделировании целевого портфеля клиента?

Чем отличается статический подход от динамического при моделировании целевого портфеля?

Какие этапы включает в себя процесс моделирования целевого портфеля?

Какие факторы следует учитывать при выборе инвестиционной стратегии для целевого портфеля клиента?

Каким образом можно адаптировать целевой портфель к изменяющимся финансовым условиям и потребностям клиента?

Тестирование

Тема 2. Риски портфельного инвестирования и способы их оценки. Агрессивный, умеренный, консервативный, сбалансированный портфели.

1. Что из перечисленного НЕ является риском, с которым могут столкнуться инвесторы?

- а. Систематический риск
- б. Несистематический риск
- в. Инфляционный риск
- г. Валютный риск

2. Какой из показателей используется для оценки систематического риска?

- а. Бета-коэффициент
- б. Альфа-коэффициент
- в. Шарповское отношение
- г. Коэффициент вариации

3. Какой из способов НЕ является методом снижения несистематического риска?

- а. Диверсификация портфеля
- б. Использование защитных активов
- в. Активный менеджмент

- г. Инвестирование в высокодоходные активы
- 4. Какому типу инвестора подходит агрессивный портфель?
 - а. Инвестору с низким горизонтом инвестирования и высокой терпимостью к риску
 - б. Инвестору с высоким горизонтом инвестирования и низкой терпимостью к риску
 - в. Инвестору, который хочет сохранить покупательную способность своих сбережений
 - г. Инвестору, который хочет получить стабильный, но небольшой доход
- 5. Каким из перечисленных активов НЕ является примером консервативного инвестиционного инструмента?
 - а. Государственные облигации
 - б. Акции высокотехнологичных компаний
 - в. Депозиты в банке
 - г. Облигации с фиксированным доходом
- 6. Какой тип портфеля обеспечивает наибольший баланс между риском и доходностью?
 - а. Агрессивный
 - б. Умеренный
 - в. Консервативный
 - г. Сбалансированный
- 7. Какой из показателей используется для оценки доходности портфеля?
 - а. Бета-коэффициент
 - б. Альфа-коэффициент
 - в. Шарповское отношение
 - г. Коэффициент вариации
- 8. Как инвестор может рассчитать ожидаемую доходность портфеля?
 - а. Суммировать ожидаемые доходности всех активов в портфеле
 - б. Умножить ожидаемую доходность каждого актива на его вес в портфеле
 - в. Скорректировать ожидаемую доходность портфеля на его систематический риск
 - г. Все перечисленные
- 9. Какой из факторов НЕ влияет на уровень риска портфеля?
 - а. Состав портфеля
 - б. Продолжительность инвестирования
 - в. Текущая экономическая ситуация
 - г. Личные качества инвестора
- 10. Как инвестор может оптимизировать свой портфель?
 - а. Регулярно пересматривать его состав
 - б. Добавлять в портфель активы с низким риском
 - в. Использовать профессиональные услуги по управлению активами
 - г. Все перечисленные

Тема 4. Портфель цифровых активов

- 1. Что из перечисленного НЕ является цифровым активом?
 - а. Криптовалюта
 - б. Токен безопасности
 - в. Акция компании, торгуемая на бирже
 - г. Цифровой коллекционный предмет
- 2. Какая из главных целей создания портфеля цифровых активов?
 - а. Сохранение покупательной способности средств
 - б. Получение прибыли от роста курса криптовалют
 - в. Диверсификация инвестиционного портфеля
 - г. Все перечисленные

3. Каким из перечисленных факторов НЕ следует руководствоваться при формировании портфеля цифровых активов?
 - а. Своими инвестиционными целями и терпимостью к риску
 - б. Текущими трендами на рынке криптовалют
 - в. Рекомендациями финансовых советников
 - г. Эмоциональными соображениями
4. Каким образом можно диверсифицировать портфель цифровых активов?
 - а. Инвестировать в различные криптовалюты с разными характеристиками
 - б. Добавить в портфель токены безопасности
 - в. Инвестировать в цифровые коллекционные предметы
 - г. Все перечисленные
5. Что такое криптовалютный индекс и для чего он используется?
 - а. Это показатель, который отражает изменение курса определенной группы криптовалют
 - б. Это инструмент для инвестирования в криптовалютный рынок
 - в. Это способ майнинга криптовалюты
 - г. Это тип криптокошелька
6. Как инвестор может оценить потенциал криптовалюты?
 - а. Изучить белую книгу проекта
 - б. Проанализировать технические характеристики криптовалюты
 - в. Оценить команду разработчиков проекта
 - г. Все перечисленные
7. Какие риски связаны с инвестированием в цифровые активы?
 - а. Высокая волатильность курса
 - б. Отсутствие правового регулирования
 - в. Угрозы безопасности
 - г. Все перечисленные
8. Как инвестор может защитить свои цифровые активы?
 - а. Хранить их на надежном аппаратном кошельке
 - б. Использовать зарекомендовавшие себя криптовалютные биржи
 - в. Не делиться с кем-либо своими приватными ключами
 - г. Все перечисленные
9. Какое будущее ждет рынок цифровых активов?
 - а. Он будет расти и развиваться
 - б. Он станет частью традиционной финансовой системы
 - в. Он будет подвержен жесткому регулированию
 - г. Все перечисленные
10. Каким образом инвестору следует подходить к инвестированию в цифровые активы?
 - а. Инвестировать только те средства, которые он может позволить себе потерять
 - б. Проводить тщательный анализ перед инвестированием
 - в. Не поддаваться FOMO (страху упустить выгоду)
 - г. Все перечисленные

4.3 Промежуточная аттестация по дисциплине проводится в форме зачета

Типовые вопросы зачета (ПК-5)

1. Анализ финансового положения клиента.
2. Расчет размера инвестиций, необходимого для достижения целей клиента.
3. Расчет целевой доходности в зависимости от финансовых целей и начального капитала.
4. Проведение расчетов величины портфеля, достаточной для покрытия финансовых целей.

5. Выявление несоответствий текущего финансового состояния клиента его финансовым целям.
6. Подбор классов активов и финансовых продуктов в соответствии с потребностями клиента.
7. Проведение стресс-тестов и сценарного анализа. Установление критериев оценки показателей инвестиционного портфеля.
8. Пересмотр (ребалансировка) состава активов клиентского портфеля.
9. Презентация согласованных финансовых решений клиенту.
10. Определение критериев взаимодействия с клиентом.
11. Согласование условий инвестиционного портфеля с клиентом.
12. Регулярный пересмотр качества инвестиционного портфеля клиента (селекция и аллокация активов).

Типовые задания для зачета (ПК-5)

Не предусмотрено

4.4. Шкала оценивания промежуточной аттестации

Оценка	Компетенции	Дескрипторы (уровни) – основные признаки освоения (показатели достижения результата)
«зачтено» (50 - 100 баллов)	ПК-5	Владеет знаниями целевой доходности и риска, оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования, на основе чего может принимать решение о выборе оптимальной модели целевого инвестиционного портфеля, в том числе цифровых активов.
«не зачтено» (0 - 49 баллов)	ПК-5	Не владеет знаниями целевой доходности и риска, оценки ключевых показателей реализации целей инвестирования, на основе чего не может принимать решение о выборе оптимальной модели целевого инвестиционного портфеля, в том числе цифровых активов.

5. Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)

5.1 Методические указания по организации самостоятельной работы обучающихся:

Приступая к изучению дисциплины, в первую очередь обучающимся необходимо ознакомиться содержанием рабочей программы дисциплины (РПД), которая определяет содержание, объем, а также порядок изучения и преподавания учебной дисциплины, ее раздела, части.

Для самостоятельной работы важное значение имеют разделы «Объем и содержание дисциплины», «Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины» и «Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы».

В разделе «Объем и содержание дисциплины» указываются все разделы и темы изучаемой дисциплины, а также виды занятий и планируемый объем в академических часах.

В разделе «Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины» указана рекомендуемая основная и дополнительная литература.

В разделе «Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы» содержится перечень профессиональных баз данных и информационных справочных систем, необходимых для освоения дисциплины.

5.2 Рекомендации обучающимся по работе с теоретическими материалами по дисциплине

При изучении и проработке теоретического материала необходимо:

- просмотреть еще раз презентацию лекции в системе MOODLe, повторить законспектированный на лекционном занятии материал и дополнить его с учетом рекомендованной дополнительной литературы;
- при самостоятельном изучении теоретической темы сделать конспект, используя рекомендованные в РПД источники, профессиональные базы данных и информационные справочные системы;
- ответить на вопросы для самостоятельной работы, по теме представленные в пункте 3.2 РПД.
- при подготовке к текущему контролю использовать материалы фонда оценочных средств (ФОС).

5.3 Рекомендации по работе с научной и учебной литературой

Работа с основной и дополнительной литературой является главной формой самостоятельной работы и необходима при подготовке к устному опросу на семинарских занятиях, к дебатам, тестированию, экзамену. Она включает проработку лекционного материала и рекомендованных источников и литературы по тематике лекций.

Конспект лекции должен содержать реферативную запись основных вопросов лекции, в том числе с опорой на размещенные в системе MOODLe презентации, основных источников и литературы по темам, выводы по каждому вопросу. Конспект может быть выполнен в рамках распечатки выдачи презентаций лекций или в отдельной тетради по предмету. Он должен быть аккуратным, хорошо читаемым, не содержать не относящуюся к теме информацию или рисунки.

Конспекты научной литературы при самостоятельной подготовке к занятиям должны содержать ответы на каждый поставленный в теме вопрос, иметь ссылку на источник информации с обязательным указанием автора, названия и года издания используемой научной литературы. Конспект может быть опорным (содержать лишь основные ключевые позиции), но при этом позволяющим дать полный ответ по вопросу, может быть подробным. Объем конспекта определяется самим студентом.

В процессе работы с основной и дополнительной литературой студент может:

- делать записи по ходу чтения в виде простого или развернутого плана (создавать перечень основных вопросов, рассмотренных в источнике);
- составлять тезисы (цитирование наиболее важных мест статьи или монографии, короткое изложение основных мыслей автора);
- готовить аннотации (краткое обобщение основных вопросов работы);
- создавать конспекты (развернутые тезисы).

5.4. Рекомендации по подготовке к отдельным заданиям текущего контроля

Собеседование предполагает организацию беседы преподавателя со студентами по вопросам практического занятия с целью более обстоятельного выявления их знаний по определенному разделу, теме, проблеме и т.п. Все члены группы могут участвовать в обсуждении, добавлять информацию, дискутировать, задавать вопросы и т.д.

Устный опрос может применяться в различных формах: фронтальный, индивидуальный, комбинированный. Основные качества устного ответа подлежащего оценке:

- правильность ответа по содержанию;
- полнота и глубина ответа;
- сознательность ответа;
- логика изложения материала;
- рациональность использованных приемов и способов решения поставленной учебной задачи;
- своевременность и эффективность использования наглядных пособий и технических средств при ответе;
- использование дополнительного материала;
- рациональность использования времени, отведенного на задание.

Устный опрос может сопровождаться презентацией, которая подготавливается по одному из вопросов практического занятия. При выступлении с презентацией необходимо обращать внимание на такие моменты как:

- содержание презентации: актуальность темы, полнота ее раскрытия, смысловое содержание, соответствие заявленной темы содержанию, соответствие методическим требованиям (цели, ссылки на ресурсы, соответствие содержания и литературы), практическая направленность, соответствие содержания заявленной форме, адекватность использования технических средств учебным задачам, последовательность и логичность презентуемого материала;
- оформление презентации: объем (оптимальное количество), дизайн (читаемость, наличие и соответствие графики и анимации, звуковое оформление, структурирование информации, соответствие заявленным требованиям), оригинальность оформления, эстетика, использование возможности программной среды, соответствие стандартам оформления;
- личностные качества: ораторские способности, соблюдение регламента, эмоциональность, умение ответить на вопросы, систематизированные, глубокие и полные знания по всем разделам программы;
- содержание выступления: логичность изложения материала, раскрытие темы, доступность изложения, эффективность применения средств ИКТ, способы и условия достижения результативности и эффективности для выполнения задач своей профессиональной или учебной деятельности, доказательность принимаемых решений, умение аргументировать свои заключения, выводы.

6. Учебно-методическое и информационное обеспечение дисциплины

6.1 Основная литература:

1. Никитина Т. В., Репета-Турсунова А. В., Фрёммель М., Ядрин А. В. Основы портфельного инвестирования : учебник для вузов. - испр. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 195 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/537915>
2. Комкова И. Н. Ценные бумаги в инвестировании: учебное пособие для студентов магистратуры направления «Экономика» : учебное пособие. - Москва: Российский университет транспорта (РУТ (МИИТ)), 2021. - 109 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=703212>
3. Лимитовский М. А. Инвестиционные проекты и реальные опционы на развивающихся рынках : учебное пособие для вузов. - пер. и доп; 5-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 486 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/535451>
4. Борисова О. В., Малых Н. И., Овешникова Л. В. Инвестиции : учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 482 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/542657>
5. Погодина Т. В. Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 229 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/536449>
6. Теплова Т. В. Инвестиции : учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 781 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/534717>
7. Аскинадзи В. М., Максимова В. Ф. Инвестиции. Практический курс : учебное пособие для вузов. - пер. и доп; 3-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 154 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/534919>
8. Аскинадзи В. М., Максимова В. Ф. Инвестиции : учебник для вузов. - пер. и доп; 3-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 386 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/535845>
9. Касьяненко Т. Г., Маховикова Г. А. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 560 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/538794>
10. Воронцовский А. В. Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики : учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 407 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/535368>
11. Румянцева Е. Е. Инвестиционный анализ : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 281 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/538215>

6.2 Дополнительная литература:

1. Глотов В. И., Альбеков А. У., Алифанова Е. Н., Аржанова И. М., Бричка Е. И. Финансовый мониторинг : учебник. - Ростов-на-Дону: Издательско-полиграфический комплекс РГЭУ (РИНХ), 2019. - 174 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <http://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=567683>
2. Теплова Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 1 : Учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2020. - 409 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/451566>
3. Теплова Т. В. Инвестиции в 2 ч. Часть 2 : Учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2021. - 382 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/470490>
4. Румянцева Е. Е. Инвестиционный анализ : Учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2021. - 281 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/471322>
5. Борисова О. В., Малых Н. И., Овешникова Л. В. Инвестиции в 2 т. Т. 1. Инвестиционный анализ : Учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2021. - 218 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/469191>
6. Хачатрян А. Как зарабатывать на акциях: анализируем рынок, выбираем компании и формируем портфель : практическое руководство. - Москва: Альпина Паблишер, 2022. - 216 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=707569>
7. Федотова М. Ю., Тагирова О. А. Оценка финансовых активов и современные портфельные теории : учебное пособие. - Пенза: ПГАУ, 2020. - 115 с. - URL: <https://e.lanbook.com/book/170992>
8. Белов В. А. Ценные бумаги в коммерческом обороте: курс лекций : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 306 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/540265>
9. Бурдина А. А., Москвичева Н. В., Мелик-Асланова Н. О. Ценные бумаги : учебное пособие. - Москва: МАИ, 2021. - 95 с. - URL: <https://e.lanbook.com/book/256259>
10. Чараева М. В., Кирьянов Е. О. Финансово-инвестиционная стратегия российских промышленных предприятий: от формирования до реализации : монография. - Б.м.: б.и., б.г. - 210 с. - Текст : электронный // ЭБС «Университетская библиотека онлайн» [сайт]. - URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=567461>
11. Лаптева А. М. Инвестиционные режимы. Правовые аспекты : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 284 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/541731>
12. Иншакова А. О., Матыцин Д. Е., Рыженков А. Я., Балтутите И. В., Гончаров А. И., Гончарова М. В., Давудов Д. А., Дерюгина Т. В., Землячева Е. А., Иловайский И. Б., Казаченок О. П., Казаченок С. Ю., Квициния Н. В., Копьёв А. В., Коробов О. А., Мартиросян М. Г., Осадченко Э. О., Тарасова А. Г., Тымчук Инвестиционное право : учебник для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 402 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/556083>
13. Кузнецов Б. Т. Инвестиционный анализ : учебник и практикум для вузов. - испр. и доп; 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 363 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/536003>
14. Зайцев Ю. К. Инвестиционный климат : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 123 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/539989>
15. Бычкова С. Г., Паршинцева Л. С. Статистика инвестиций : учебник и практикум для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 55 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/544564>
16. Фархутдинов И. З., Трапезников В. А. Инвестиционное право : учебник и практикум для вузов. - пер. и доп; 3-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 305 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/540843>

17. Лаптева А. М., Скворцов О. Ю. Инвестиционное право. Практикум : учебное пособие для вузов. - Москва: Юрайт, 2024. - 331 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/543463>

18. Кузнецов Д. В., Корецкая Л. К., Балынин И. В., Булгаевский Г. Ф., Власова Н. В., Губернаторов А. М., Ломов Е. Е., Новикова Т. А., Савельев И. И., Ловкова Е. С., Шмелева Л. А. Инвестиционный менеджмент : учебник и практикум для вузов. - 2-е изд.. - Москва: Юрайт, 2024. - 289 с. - Текст : электронный // ЭБС «ЮРАЙТ» [сайт]. - URL: <https://urait.ru/bcode/536440>

6.3 Иные источники:

1. Журнал «Аудит и финансовый анализ» - <http://www.auditfin.com/>
2. Журнал «Финансы и кредит» - <http://www.fin-izdat.ru/journal/fc/>
3. Журнал «Эксперт» - <http://www.expert.ru> - <http://www.expert.ru>
4. Журнал о бирже - <https://expert.ru/d-stroke/>
5. Журнал Финансовый менеджмент - <http://www.finman.ru/>

7. Материально-техническое обеспечение дисциплины, программное обеспечение, профессиональные базы данных и информационные справочные системы

Для проведения занятий по дисциплине необходимо следующее материально-техническое обеспечение: учебные аудитории для проведения занятий лекционного и семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, помещения для самостоятельной работы.

Учебные аудитории и помещения для самостоятельной работы укомплектованы специализированной мебелью и техническими средствами обучения, служащими для представления учебной информации большой аудитории.

Помещения для самостоятельной работы укомплектованы компьютерной техникой с возможностью подключения к сети "Интернет" и обеспечением доступа в электронную информационно-образовательную среду Университета.

Для проведения занятий лекционного типа используются наборы демонстрационного оборудования, обеспечивающие тематические иллюстрации (проектор, ноутбук, экран/ интерактивная доска).

Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение:

Adobe Flash Player 29 PPAPI Adobe Systems Incorporated 15.06.2018 29.0.0.140

Microsoft Office Профессиональный плюс 2007

Операционная система Microsoft Windows 7, 8, 10

Профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

1. Scopus: база данных . – URL: <https://www.scopus.com>
2. Springer Open (ресурсы Springer открытого доступа): база данных. – URL: <https://www.springeropen.com>
3. Президентская библиотека имени Б.Н. Ельцина. – URL: <https://www.prilib.ru>
4. Справочная правовая система "Консультант плюс". – URL: <http://www.consultant.ru>
5. Электронный каталог Фундаментальной библиотеки ТГУ. – URL: <https://www.tsutmb.ru/biblio/elektronnyij-katalog/>
6. Юрайт: образовательная платформа, электронно-библиотечная система. – URL: <https://urait.ru>
7. ЭБС «Университетская библиотека онлайн» . – URL: <http://www.biblioclub.ru>

Электронная информационно-образовательная среда

https://auth.tsutmb.ru/authorize?response_type=code&client_id=moodle&state=xyz

Взаимодействие преподавателя и студента в процессе обучения осуществляется посредством мультимедийных, гипертекстовых, сетевых, телекоммуникационных технологий, используемых в электронной информационно-образовательной среде университета.