

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Косенок Сергей Михайлович
Должность: ректор
Дата подписания: 16.06.2026 11:52:54
Уникальный программный ключ:
e3a68f3eaa1e62674b54f4998099d3d6bfdcf836

Бюджетное учреждение высшего образования
Ханты-Мансийского автономного округа-Югры
"Сургутский государственный университет"

УТВЕРЖДАЮ
Проректор по УМР

_____ Е.В. Коновалова

11 июня 2026 г., протокол УМС №5

МОДУЛЬ ДИСЦИПЛИН ПРОФИЛЬНОЙ НАПРАВЛЕННОСТИ

Управление инвестиционным портфелем рабочая программа дисциплины (модуля)

Закреплена за кафедрой **Экономики, учета и финансов**
Учебный план b380301-ФиК-26-4.plx
38.03.01 Экономика
Направленность (профиль): Финансы и кредит
Квалификация **бакалавр**
Форма обучения **очная**
Общая трудоемкость **3 ЗЕТ**

Часов по учебному плану 108
в том числе:
аудиторные занятия 32
самостоятельная работа 49
часов на контроль 27

Виды контроля в семестрах:
экзамен 8
контрольная работа 8

Распределение часов дисциплины по семестрам

Семестр (<Курс>.<Семестр на курсе>)	8 (4.2)		Итого	
	уп	рп		
Неделя	9 1/6		уп	рп
Лекции	16	16	16	16
Практические	16	16	16	16
Итого ауд.	32	32	32	32
Контактная работа	32	32	32	32
Сам. работа	49	49	49	49
Часы на контроль	27	27	27	27
Итого	108	108	108	108

Программу составил(и):

Доктор экон. наук, Профессор, Каратаев Алексей Сергеевич

Рабочая программа дисциплины

Управление инвестиционным портфелем

разработана в соответствии с ФГОС:

Федеральный государственный образовательный стандарт высшего образования - бакалавриат по направлению подготовки 38.03.01 Экономика (приказ Минобрнауки России от 12.08.2020 г. № 954)

составлена на основании учебного плана:

38.03.01 Экономика

Направленность (профиль): Финансы и кредит

утвержденного учебно-методическим советом вуза от 11.06.2026 протокол № 5.

Рабочая программа одобрена на заседании кафедры

Экономики, учета и финансов

Зав. кафедрой к.э.н., доцент Пучкова Н.В.

1. ЦЕЛИ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

1.1	овладение методиками сбора и анализа данных из области функционирования российского рынка ценных бумаг;
1.2	ознакомление с современными методами формирования портфелей ценных бумаг;
1.3	развитие умений и навыков расчета доходности и риска портфелей ценных бумаг.

2. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ООП

Цикл (раздел) ООП:	Б1.В.01
2.1	Требования к предварительной подготовке обучающегося:
2.1.1	Финансовые рынки
2.1.2	Современная финансовая система и финансовая политика
2.2	Дисциплины и практики, для которых освоение данной дисциплины (модуля) необходимо как предшествующее:
2.2.1	Подготовка к сдаче и сдача государственного экзамена
2.2.2	Подготовка к процедуре защиты и защита выпускной квалификационной работы

3. КОМПЕТЕНЦИИ ОБУЧАЮЩЕГОСЯ, ФОРМИРУЕМЫЕ В РЕЗУЛЬТАТЕ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

ПК-1.2: Использует полученные данные о состоянии и тенденциях развития финансового рынка и его секторов для обеспечения эффективной деятельности экономических субъектов

В результате освоения дисциплины обучающийся должен

3.1	Знать:
3.1.1	- виды сделок и операции с ценными бумагами и другими финансовыми активами, модели формирования портфеля финансовых активов;
3.1.2	- основные положения портфельной теории.
3.2	Уметь:
3.2.1	- оценивать доходность сделок и операций с ценными бумагами и другими финансовыми активами при формировании портфеля финансовых активов;
3.2.2	- формировать оптимальную структуру инвестиционного портфеля.

4. СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Код занятия	Наименование разделов и тем /вид занятия/	Семестр / Курс	Часов	Компетенции	Литература	Примечание
	Раздел 1. Основы портфельной теории					
1.1	Современная портфельная теория /Лек/	8	4	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2 Э3	
1.2	Современная портфельная теория /Пр/	8	2	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.4 Л1.5Л2.1 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2 Э3	
1.3	Современная портфельная теория /Ср/	8	12	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.4 Л1.5Л2.2 Л2.3 Л2.4 Э1 Э2 Э3	
1.4	Многокритериальная портфельная оптимизация /Лек/	8	0	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3 Л2.4 Э1 Э2 Э3	

1.5	Многокритериальная портфельная оптимизация /Пр/	8	2	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3 Л2.4Л3.1 Э1 Э2 Э3	
1.6	Многокритериальная портфельная оптимизация /Ср/	8	12	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4Л2.2 Л2.3 Л2.4 Э1 Э2 Э3	
Раздел 2. Формирование портфеля финансовых активов						
2.1	Модель Марковица /Лек/	8	6	ПК-1.2	Л1.3Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.2	Модель Марковица /Пр/	8	6	ПК-1.2	Л1.3Л2.5Л3.1 Э1 Э2 Э3	
2.3	Модель Марковица /Ср/	8	7	ПК-1.2	Л1.3Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.4	Альтернативные портфели финансовых активов /Лек/	8	4	ПК-1.2	Л1.3 Л1.4Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.5	Альтернативные портфели финансовых активов /Пр/	8	6	ПК-1.2	Л1.3 Л1.4Л2.5Л3.1 Э1 Э2 Э3	
2.6	Альтернативные портфели финансовых активов /Ср/	8	8	ПК-1.2	Л1.3 Л1.4Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.7	Портфельная психология /Лек/	8	2	ПК-1.2	Л1.6Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.8	Портфельная психология /Ср/	8	10	ПК-1.2	Л1.6Л2.5 Э1 Э2 Э3	
2.9	/Контр.раб./	8	0	ПК-1.2	Э1 Э2 Э3	Задание на контрольную работу
2.10	/Экзамен/	8	27	ПК-1.2	Л1.1 Л1.2 Л1.3 Л1.4 Л1.5 Л1.6Л2.1 Л2.2 Л2.3 Л2.4 Л2.5 Э1 Э2 Э3	Задание на экзамен

5. ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

5.1. Оценочные материалы для текущего контроля и промежуточной аттестации

Представлены отдельным документом

5.2. Оценочные материалы для диагностического тестирования

Представлены отдельным документом

6. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

6.1. Рекомендуемая литература

6.1.1. Основная литература

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л1.1	Лукаевич И. Я.	Финансовая политика: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2025, электронный ресурс	1

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л1.2	Воронцовский А. В.	Управление инвестициями: инвестиции и инвестиционные риски в реальном секторе экономики: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
Л1.3	Поляк Г., Лукасевич И. Я., Пантелеев А. П., Половников В. А.	Финансовый менеджмент: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
Л1.4	Аскинадзи В. М., Максимова В. Ф.	Инвестиции: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
Л1.5	Берзон Н. И., Касаткин Д. М., Аршавский А. Ю., Меньшиков С. М., Сорокин И. А., Лысенко Н. И., Галанова А. В., Красильников А. С., Курочкин С. В., Столяров А. И., Соколова Т. В., Ткаченко М. В.	Рынок ценных бумаг: учебник для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
Л1.6	Алехин Б. И.	Поведенческие финансы: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
6.1.2. Дополнительная литература				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л2.1	Белопольская Я. И.	Стохастическая оптимизация портфельных инвестиций: Учебное пособие	Санкт-Петербург: Санкт-Петербургский государственный архитектурно-строительный университет, ЭБС АСВ, 2014, электронный ресурс	1
Л2.2	Скрипниченко М.В.	Портфельные инвестиции: учебное пособие	Санкт-Петербург: Университет ИТМО, 2016, электронный ресурс	1
Л2.3	Косова, Л. Н., Косова, Ю. А.	Рынок ценных бумаг: конспект лекций	Москва: Российский государственный университет правосудия, 2019, электронный ресурс	1
Л2.4	Золкина, А. В., Панасюк, А. А., Анисимов, А. Ю., Кокорев, И. А.	Рынок ценных бумаг: учебное пособие и практикум	Москва: Институт мировых цивилизаций, 2019, электронный ресурс	1

	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л2.5	Лукаевич И. Я.	Финансовый менеджмент: учебник и практикум для вузов	Москва: Юрайт, 2026, электронный ресурс	1
6.1.3. Методические разработки				
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год	Колич-во
Л3.1	Балтина А. М., Яковлева И. В.	Инвестиции: методические указания	Оренбург: ОГУ, 2025, электронный ресурс	1
6.2. Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети "Интернет"				
Э1	ИСС Консультант Плюс https://www.consultant.ru/			
Э2	ИСС Гарант https://www.garant.ru/			
Э3	Федеральная база государственной статистики https://rosstat.gov.ru/			
6.3.1 Перечень программного обеспечения				
6.3.1.1	Программы, обеспечивающие доступ в сеть Интернет (например, «Google Chrome», «Yandex», «Internet Explorer»);			
6.3.1.2	Программы для демонстрации и создания презентаций (например, «Microsoft Power Point»)			
6.3.2 Перечень информационных справочных систем				
6.3.2.1	http://www.garant.ru Информационно-правовой портал Гарант.ру			
6.3.2.2	http://www.consultant.ru/ Справочно-правовая система Консультант Плюс			

7. МАТЕРИАЛЬНО-ТЕХНИЧЕСКОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

7.1	Учебная аудитория для проведения занятий лекционного типа, занятий семинарского типа (лабораторных занятий), групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации оснащена: комплект специализированной учебной мебели, маркерная (меловая) доска, комплект переносного мультимедийного оборудования - компьютер, проектор, проекционный экран, компьютеры с возможностью выхода в Интернет и доступом в электронную информационно-образовательную среду. Обеспечен доступ к сети Интернет и в электронную информационную среду организации			
-----	--	--	--	--