

Документ подписан простой электронной подписью
Информация о владельце:
ФИО: Ястребов Олег Александрович
Должность: Ректор
Дата подписания: 22.05.2025 16:37:41
Уникальный программный ключ:
sa953a0120d891083f939673078ef1a989dae18a

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

Экономический факультет

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

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

УПРАВЛЕНИЕ ПОРТФЕЛЕМ ЦЕННЫХ БУМАГ

(наименование дисциплины/модуля)

Рекомендована МССН для направления подготовки/специальности:

38.03.01 ЭКОНОМИКА

(код и наименование направления подготовки/специальности)

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

БУХГАЛТЕРСКИЙ УЧЕТ И АУДИТ

(наименование (профиль/специализация) ОП ВО)

2025 г.

1. ЦЕЛЬ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Дисциплина «Управление портфелем ценных бумаг» входит в программу бакалавриата «Бухгалтерский учет и аудит» по направлению 38.03.01 «Экономика» и изучается в 7 семестре 4 курса. Дисциплину реализует Кафедра «Финансы, учет и аудит». Дисциплина состоит из 3 разделов и 8 тем и направлена на изучение теоретических и практических аспектов управления портфелем ценных бумаг

Целью освоения дисциплины является формирование у обучающихся компетенций в области портфельного инвестирования и развитие практических навыков формирования портфеля ценных бумаг с учетом российского и зарубежного опыта портфельного управления

2. ТРЕБОВАНИЯ К РЕЗУЛЬТАТАМ ОСВОЕНИЯ ДИСЦИПЛИНЫ

Освоение дисциплины «Управление портфелем ценных бумаг» 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	Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	УК-1.1 Осуществляет поиск информации для решения поставленной задачи по различным типам запросов; УК-1.2 Анализирует и контекстно обрабатывает информацию для решения поставленных задач с формированием собственных мнений и суждений; УК-1.3 Предлагает варианты решения задачи, анализирует возможные последствия их использования;
УК-12	Способен: искать нужные источники информации и данные, воспринимать, анализировать, запоминать и передавать информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач; проводить оценку информации, ее достоверность, строить логические умозаключения на основании поступающих информации и данных	УК-12.1 Осуществляет поиск нужных источников информации и данных, воспринимает, анализирует, запоминает и передает информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач; УК-12.2 Проводит оценку информации, ее достоверность, строит логические умозаключения на основании поступающих информации и данных;
ПК-1	Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собирать необходимые данные, анализировать их и готовить информационные обзоры и аналитические отчеты для решения задач профессиональной деятельности	ПК-1.1 Осуществляет поиск информации для решения, поставленной задачи профессиональной деятельности; ПК-1.2 Анализирует и контекстно обрабатывает информацию для решения поставленных профессиональных задач; ПК-1.3 Обобщает, обосновывает и готовит информационные обзоры и аналитические отчеты для решения задач профессиональной деятельности;

3. МЕСТО ДИСЦИПЛИНЫ В СТРУКТУРЕ ОП ВО

Дисциплина «Управление портфелем ценных бумаг» относится к части, формируемой участниками образовательных отношений блока 1 «Дисциплины (модули)» образовательной программы высшего образования.

В рамках образовательной программы высшего образования обучающиеся также осваивают другие дисциплины и/или практики, способствующие достижению запланированных результатов освоения дисциплины «Управление портфелем ценных бумаг».

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-12	Способен: искать нужные источники информации и данные, воспринимать, анализировать, запоминать и передавать информацию с использованием цифровых средств, а также с помощью алгоритмов при работе с полученными из различных источников данными с целью эффективного использования полученной информации для решения задач; проводить оценку информации, ее достоверность, строить логические умозаключения на основании поступающих информации и данных	Цифровая грамотность; Python и SQL в экономике и управлении; <i>Навыки и технологии публичных презентаций**;</i> <i>Введение в цифровизацию учета бизнес-процессов**;</i> <i>Теория и практика международного бизнеса**;</i> <i>Тайм-менеджмент**;</i> <i>Математическая логика и теория алгоритмов**;</i> <i>Визуализация пространственных данных в экономике**;</i> <i>Комплаенс документации**;</i> <i>Управление талантами**;</i> <i>Основы налоговых правоотношений в учете**;</i> <i>Самокоучинг**;</i> <i>Корпоративное мошенничество: как обезопасить бизнес**;</i> <i>Дизайн-мышление**;</i> <i>Эмоциональный интеллект**;</i> <i>Нейромаркетинг**;</i> <i>Персональный брендинг**;</i> <i>Малое предпринимательство в рыночной экономике**;</i> <i>Моделирование бизнес-процессов**;</i> <i>Бизнес в Интернет**;</i> <i>Методы оптимальных решений**;</i> <i>Основы бизнес-аналитики**;</i> <i>Phygital-технологии в экономике**;</i> <i>Креативная экономика в городах и регионах**;</i> <i>Брендинг территорий**;</i> <i>Девелопмент: городские и региональные инвестиционные проекты**;</i> <i>Современные финансовые технологии**;</i>	

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		<i>Основы финансового прогнозирования**;</i> <i>Цифровой банкинг**;</i> <i>Коммуникации в экономике и управлении**;</i> <i>Технологический суверенитет в многополярном мире**;</i> <i>Креативность и инновации в бизнесе**;</i> <i>Основы научных исследований**;</i> <i>Безопасность в цифровой среде**;</i> <i>Международные экономические организации**;</i> <i>"Мягкая сила" в мировой экономике**;</i> <i>Мировые финансовые центры**;</i> <i>История финансовых потрясений в мировой экономике**;</i> <i>Эконометрика;</i> <i>Экономика и финансы устойчивого развития**;</i> <i>Умный город: практика внедрения цифровых технологий**;</i> <i>Цифровые технологии в управлении**;</i> <i>Психология личности и профессиональное самоопределение**;</i> <i>Основы международных стандартов учета и аудита**;</i> <i>Основы предпринимательства**;</i> <i>Продвинутый Excel**;</i> <i>Визуализация данных с использованием инструментов искусственного интеллекта**;</i> <i>Тренинг: работа с международной статистикой**;</i> <i>Бизнес-климат и регулирование иностранных инвестиций в РФ**;</i> <i>Страховой бизнес**;</i> <i>Основы трейдинга на фондовом рынке**;</i>	
УК-1	Способен осуществлять поиск, критический анализ и синтез информации, применять системный подход для решения поставленных задач	<i>Психология личности и профессиональное самоопределение**;</i> <i>Основы международных стандартов учета и аудита**;</i> <i>Основы предпринимательства**;</i> <i>Тренинг: работа с международной статистикой**;</i> <i>Бизнес-климат и регулирование иностранных инвестиций в РФ**;</i> <i>Страховой бизнес**;</i> <i>Основы трейдинга на фондовом рынке**;</i>	Преддипломная практика;

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		<i>Statistical Tools Scientific Research**;</i> <i>Статистические инструменты научного исследования**;</i> Ознакомительная практика; Проектно-технологическая практика; Экономическая география; Математика (Часть 1); Микроэкономика; Макроэкономика; Мировая экономика; Экономическая статистика; Математика (Часть 2); Маркетинг; Методика написания курсовой работы; <i>Навыки и технологии публичных презентаций**;</i> <i>Введение в цифровизацию учета бизнес-процессов**;</i> <i>Теория и практика международного бизнеса**;</i> <i>Тайм-менеджмент**;</i> <i>Математическая логика и теория алгоритмов**;</i> <i>Визуализация пространственных данных в экономике**;</i> <i>Комплаенс документации**;</i> <i>Управление талантами**;</i> <i>Основы налоговых правоотношений в учете**;</i> <i>Самокоучинг**;</i> <i>Корпоративное мошенничество: как обезопасить бизнес**;</i> <i>Дизайн-мышление**;</i> <i>Эмоциональный интеллект**;</i> <i>Нейромаркетинг**;</i> <i>Персональный брендинг**;</i> <i>Малое предпринимательство в рыночной экономике**;</i> <i>Моделирование бизнес-процессов**;</i> <i>Бизнес в Интернет**;</i> <i>Методы оптимальных решений**;</i> <i>Основы бизнес-аналитики**;</i> <i>Phygital-технологии в экономике**;</i> <i>Креативная экономика в городах и регионах**;</i> <i>Брендинг территорий**;</i> <i>Девелопмент: городские и региональные инвестиционные проекты**;</i> <i>Современные финансовые технологии**;</i> <i>Основы финансового прогнозирования**;</i> <i>Цифровой банкинг**;</i>	

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		Коммуникации в экономике и управлении**; Технологический суверенитет в многополярном мире**; Креативность и инновации в бизнесе**; Основы научных исследований**; Безопасность в цифровой среде**; Международные экономические организации**; "Мягкая сила" в мировой экономике**; Мировые финансовые центры**; История финансовых потрясений в мировой экономике**; Институциональная экономика; Международные экономические отношения; Экономика природопользования**; Региональная экономика**; Экономика и финансы устойчивого развития**; Умный город: практика внедрения цифровых технологий**; Цифровые технологии в управлении**;	
ПК-1	Способен, используя отечественные и зарубежные источники информации, собирать необходимые данные, анализировать их и готовить информационные обзоры и аналитические отчёты для решения задач профессиональной деятельности	Экономическая география; Правоведение; Экономика предприятия; Python и SQL в экономике и управлении; Управление человеческими ресурсами; Навыки и технологии публичных презентаций**; Введение в цифровизацию учета бизнес-процессов**; Теория и практика международного бизнеса**; Тайм-менеджмент**; Математическая логика и теория алгоритмов**; Визуализация пространственных данных в экономике**; Комплаенс документации**; Управление талантами**; Основы налоговых правоотношений в учете**; Самокоучинг**; Корпоративное мошенничество: как обезопасить бизнес**; Дизайн-мышление**; Эмоциональный интеллект**; Нейромаркетинг**; Персональный брендинг**; Малое предпринимательство в	

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		<i>рыночной экономике**;</i> <i>Моделирование бизнес-процессов**;</i> <i>Бизнес в Интернет**;</i> <i>Методы оптимальных решений**;</i> <i>Основы бизнес-аналитики**;</i> <i>Phygital-технологии в экономике**;</i> <i>Креативная экономика в городах и регионах**;</i> <i>Брендинг территорий**;</i> <i>Девелопмент: городские и региональные инвестиционные проекты**;</i> <i>Современные финансовые технологии**;</i> <i>Основы финансового прогнозирования**;</i> <i>Цифровой банкинг**;</i> <i>Коммуникации в экономике и управлении**;</i> <i>Технологический суверенитет в многополярном мире**;</i> <i>Креативность и инновации в бизнесе**;</i> <i>Основы научных исследований**;</i> <i>Безопасность в цифровой среде**;</i> <i>Международные экономические организации**;</i> <i>"Мягкая сила" в мировой экономике**;</i> <i>Мировые финансовые центры**;</i> <i>История финансовых потрясений в мировой экономике**;</i> <i>Экономика и финансы устойчивого развития**;</i> <i>Умный город: практика внедрения цифровых технологий**;</i> <i>Цифровые технологии в управлении**;</i> <i>Психология личности и профессиональное самоопределение**;</i> <i>Основы международных стандартов учета и аудита**;</i> <i>Основы предпринимательства**;</i> <i>Тренинг: работа с международной статистикой**;</i> <i>Бизнес-климат и регулирование иностранных инвестиций в РФ**;</i> <i>Страховой бизнес**;</i> <i>Основы трейдинга на фондовом рынке**;</i> <i>Продвинутый Excel**;</i> <i>Визуализация данных с использованием инструментов</i>	

Шифр	Наименование компетенции	Предшествующие дисциплины/модули, практики*	Последующие дисциплины/модули, практики*
		<i>искусственного интеллекта**;</i>	

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

** - элективные дисциплины /практики

4. ОБЪЕМ ДИСЦИПЛИНЫ И ВИДЫ УЧЕБНОЙ РАБОТЫ

Общая трудоемкость дисциплины «Управление портфелем ценных бумаг» составляет «3» зачетные единицы.

Таблица 4.1. Виды учебной работы по периодам освоения образовательной программы высшего образования для очной формы обучения.

Вид учебной работы	ВСЕГО, ак.ч.		Семестр(-ы)
			7
<i>Контактная работа, ак.ч.</i>	34		34
Лекции (ЛК)	0		0
Лабораторные работы (ЛР)	0		0
Практические/семинарские занятия (СЗ)	34		34
<i>Самостоятельная работа обучающихся, ак.ч.</i>	65		65
<i>Контроль (экзамен/зачет с оценкой), ак.ч.</i>	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

Номер раздела	Наименование раздела дисциплины	Содержание раздела (темы)		Вид учебной работы*
Раздел 1	Введение в портфельное инвестирование	1.1	Экономическая сущность портфельного инвестирования и виды инвестиционных портфелей	СЗ
		1.2	Фондовый рынок и его инструменты	СЗ
		1.3	Принципы и этапы формирования портфеля ценных бумаг	СЗ
Раздел 2	Методы и подходы к оценке ценных бумаг	2.1	Использование технического анализа при управлении портфелем ценных бумаг	СЗ
		2.2	Фундаментальный анализ ценных бумаг	СЗ
		2.3	Индикаторы и методы межрыночного анализа	СЗ
Раздел 3	Стратегии управления портфелем ценных бумаг	3.1	Основные стратегии портфельного управления	СЗ
		3.2	Оценка эффективности управления портфелем ценных бумаг	СЗ

* - заполняется только по **ОЧНОЙ** форме обучения: ЛК – лекции; ЛР – лабораторные работы; СЗ – практические/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)
Семинарская	Аудитория для проведения занятий семинарского типа, групповых и индивидуальных консультаций, текущего контроля и промежуточной аттестации, оснащенная комплектом специализированной мебели и техническими средствами мультимедиа презентаций.	Ауд. 105. Моноблок Lenovo AIO-510-22ISH Intel I5 2200 MHz/8 GB/1000 GB/DVD/audio, монитор 21" Мультимедиа проектор Casio XJ-S400UN Экран моторизованный Digis Electra MW DSEM – 1105 MS Windows 10 64bit Microsoft Office 2021 LTSC
Для самостоятельной работы	Аудитория для самостоятельной работы обучающихся (может использоваться для проведения семинарских занятий и консультаций), оснащенная комплектом специализированной мебели и компьютерами с доступом в ЭИОС.	Ауд.432 Моноблок Lenovo V30a-24IML/16 GB/512 GB/audio, монитор 24" Мультимедиа проектор Cactus CSC4.SG Экран моторизованный Targa 220*220 MS Windows 10 64bit Microsoft Office 2021 LTSC 1C Предприятие 8.3

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

7. УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Основная литература:

1. Котов Ю. Е. Российский рынок ценных бумаг : формирование инвестиционного портфеля на примере ООО «Компания БКС» : / Ю. Е. Котов ; МИЭРА - Российский технологический университет. – Москва : б.и., 2023. – 73 с. : табл. – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=704841> (дата обращения: 21.12.2023). – DOI 200. – Текст : электронный.

2. Николаева И. П. Рынок ценных бумаг : учебник / И. П. Николаева. – 5-е изд., стер. – Москва : Дашков и К°, 2024. – 254 с. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=710155> (дата обращения: 21.12.2023). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-05649-9. – Текст : электронный.

3. Рынок ценных бумаг : учебник / В. А. Зверев, А. В. Зверева, С. Г. Евсюков, А. В. Макеев. – 5-е изд., стер. – Москва : Дашков и К°, 2023. – 256 с. : ил. – (Учебные издания для бакалавров). – Режим доступа: по подписке. – URL: <https://biblioclub.ru/index.php?page=book&id=710106> (дата обращения: 21.12.2023). – Библиогр. в кн. – ISBN 978-5-394-05313-9. – Текст : электронный

Дополнительная литература:

1. Алентьева Н.В., Сидорин А.А. Фондовый рынок в современных экономических условиях // Вестник техносферной безопасности и сельского развития. 2023. Выпуск номер 3 (34), С.10-14

2. Богатырев Семен Юрьевич. Современные средства поведенческого анализа финансовых инструментов фондового рынка [Электронный ресурс] // Аудит и финансовый анализ. 2020. URL: https://mega.rudn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=Link_FindDoc&id=501035&idb=0

3. Брызгалова Мария Александровна, Виншу Дмитрий Викторович Факторы, влияющие на рынок ценных бумаг в России // Финансовые рынки и банки. 2024. Выпуск номер 2, С.77-80

4. Гурбанназаров А.О. Современный рынок ценных бумаг // Вестник науки. 2023. Выпуск номер 2 (59) том 2, С.33-36

5. Егорова Ю.В., Непп А.Н., Тищенко И.И. Эволюция влияния COVID-19 на фондовый рынок России: эффект паники // Финансы: теория и практика. 2024. Выпуск номер 2 том 28, С.192-205

6. Захарян А.В., Селеверстова В.В., Гарькавая А.Е. Рынок ценных бумаг и фондовая биржа в России: состояние и перспективы // Экономика и бизнес: теория и практика. 2023. Выпуск номер 4-1 (98), С.164-166

7. Лунева М.В. Фондовый рынок России в условиях санкций // Региональные проблемы преобразования экономики. 2022. Выпуск номер 6 (140), С.89-93

8. Овезов Д.А., Гелдиев М.Б. Регуляторы рынка ценных бумаг // Всемирный ученый. 2024. Выпуск номер 27 том 1, С.662-668

9. Теньковская Л. И. Продолжительность воздействия «индекса страха инвесторов» на российский фондовый рынок // Экономика Профессия Бизнес. 2024. Выпуск номер 1, С.77-84

10. Фархуллина А.И. Рынок ценных бумаг в России: проблемы и перспективы развития // Международный журнал гуманитарных и естественных наук. 2023. Выпуск номер 5-5 (80), С.113-115

11. Яйбылов А., Атабаева А.А., Батырова А.Б. Трансформация сбережений и накоплений в инвестиции через рынок ценных бумаг // Всемирный ученый. 2024. Выпуск номер 26 том 1, С.1170-1175

12. Pandey M. K. Examining causal relationship among stock market index, crude oil

price, exchange rate amid COVID-19 era: an empirical evidence from Indian financial market using VAR model (Взаимосвязь индийского индекса фондового рынка с ценой на нефть и обменным курсом в эпоху COVID-19: эмпирические данные индийского финансового рынка с использованием модели VAR) : статья на английском языке / М. К. Pandey, I. G. Sergeeva, V. Gudla
// Вестник Российского университета дружбы народов: Экономика. - 2021. - № т. 29 (2). - С. 278 - 298. URL:

https://mega.rudn.ru/MegaPro/UserEntry?Action=Link_FindDoc&id=501497&idb=0

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

<https://mega.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 «Знаниум» <https://znanium.ru/>

2. Базы данных и поисковые системы

- Sage <https://journals.sagepub.com/>

- Springer Nature Link <https://link.springer.com/>

- Wiley Journal Database <https://onlinelibrary.wiley.com/>

- Научометрическая база данных Lens.org <https://www.lens.org>

Учебно-методические материалы для самостоятельной работы обучающихся при освоении дисциплины/модуля:*

1. Курс лекций по дисциплине «Управление портфелем ценных бумаг».

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

РАЗРАБОТЧИК:

Доцент

Должность, БУП

Подпись

Гомонко Эвелина

Анатолевна

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ БУП:

Заведующий кафедрой

Должность БУП

Подпись

Динец Дарья

Александровна

Фамилия И.О.

РУКОВОДИТЕЛЬ ОП ВО:

Доцент

Должность, БУП

Подпись

Сорокина Лариса

Николаевна

Фамилия И.О.