|  |  |
| --- | --- |
|  | **UNIVERSITAS BALIKPAPAN**  **FAKULTAS EKONOMI**  **PROGRAM STUDI MANAJEMEN** |

**RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER (RPS)**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **Nama Mata Kuliah:**  *Investment Management & Fortofolio* | **Semester:**  7 (Tujuh) | **Mata Kuliah Prasyarat:** |
| **Kode Mata Kuliah:**  106102650 | **Bobot SKS:**  3 SKS | **Dosen Pengampu:** |

|  |  |
| --- | --- |
| **Capaian Pembelajaran Lulusan Prodi yang Dibebankan pada Mata Kuliah** | ***Aspek Sikap***   1. Menginternalisasi nilai, norma, dan etika akademik. (S8) 2. Menunjukkan sikap bertanggungjawab atas pekerjaan di bidang keahliannya secara mandiri. (S9) 3. Menginternalisasi semangat kemandirian, kejuangan, dan kewirausahaan. (S10)   ***Aspek Keterampilan Umum***   * 1. Mampu menerapkan pemikiran logis, kritis, sistematis, dan inovatif dalam konteks pengembangan atau implementasi ilmu pengetahuan dan teknologi yang memperhatikan dan menerapkan nilai humaniora yang sesuai dengan bidang ekonomi manajemen. (KU1)   2. Mampu menunjukkan kinerja mandiri, bermutu, dan terukur (KU2)   3. Mampu mengkaji implikasi pengembangan atau implementasi ilmu pengetahuan teknologi yang memperhatikan dan menerapkan nilai humaniora sesuai dengan keahliannya berdasarkan kaidah, tata cara dan etika ilmiah dalam rangka menghasilkan solusi, gagasan, desain atau kritik seni, menyusun deskripsi saintifik hasil kajiannya dalam bentuk skripsi atau laporan tugas akhir, dan mengunggahnya dalam laman perguruan tinggi. (KU3)   4. Mampu bertanggungjawab atas pencapaian hasil kerja kelompok dan melakukan supervisi dan evaluasi terhadap penyelesaian pekerjaan yang ditugaskan kepada pekerja yang berada di bawah tanggungjawabnya. (KU7)   5. Mampu melakukan proses evaluasi diri terhadap kelompok kerja yang berada dibawah tanggung jawabnya, dan mampu mengelola pembelajaran secara mandiri. (KU8)   ***Aspek Keterampilan Khusus***   1. Mampu merumuskan fungsi manajemen (perencanaan, pengorganisasian, penyusunan staf, pengarahan, dan pengendalian serta evaluasi) pada level operasional di berbagai bidang organisasi baik bisnis maupun non bisnis pada tingkat lokal, nasional dan global. (KK1) 2. Mampu mengidentifikasi masalah manajerial dan fungsi organisasi pada level operasional, serta mengambil tindakan solutif yang tepat berdasarkan alternative yang dikembangkan, dengan menerapkan prinsip-prinsip kewirausahaan yang berakar pada kearifan lokal. (KK3) 3. Mampu mengambil keputusan manajerial yang tepat di berbagai bidang organisasi pada tingkat operasional, berdasarkan analisis data dan informasi pada fungsi organisasi. (KK5)   ***Aspek Pengetahuan***   1. Menguasai konsep teoritis, metode, dan perangkat analisis fungsi manajemen (perencanaan, pelaksanaan, pengarahan, pemantauan, evaluasi, dan pengendalian) dan fungsi organisasi (pemasaran, sumber daya manusia, operasi, dan keuangan) pada berbagai jenis organisasi. (P1) 2. Menguasai prinsip kepemimpinan dan kewirausahaan dalam berbagai bidang organisasi. (P3) 3. Menguasai minimal satu metode penelitian (studi kasus, kesejarahan, survei, simulasi, dan eksperimen pada lingkup kualitatif dan kuantitatif, secara eksploratif, deskriptif, dan verifikatif). (P5) |
| **Capaian Pembelajaran Mata Kuliah** | 1. P2 Mampu menerapkan instrumen analisis bisnis dan manajemen dengan mempertimbangkan aspek etika dan profesionalitas. 2. P4 Mampu menerapkan prinsip-prinsip kepemimpinan dan kewirausahaan ke dalam organisasi dengan mempertimbangkan nilai-nilai etika dan moral |
| **Deskripsi Mata Kuliah** | Memahami konsep dasar manajemen portofolio serta berbagai instrumennya |
| **Daftar Referensi** | **Utama:** |

Rencana Pembelajaran:

|  |  |
| --- | --- |
| **Pertemuan Ke-1** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Role of Financial Assets and Markets 2. Crisis in Corporate Governance 3. nvestments and Innovation 4. Key Trends – Globalization, Securitization & Financial engineering 5. Instrumen Keuangan 6. Major Types of Securities 7. Markets and Instruments 8. Stock Market Indexes 9. Derivatives Securities 10. Primary vs. Secondary Security Sales 11. Investment Banking Arrangements 12. Public Offerings 13. Private Placements 14. Types of Orders; margin trading, short sales, margin call |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | 1. Investments & Financial Assets 2. Financial Instruments Perdagangan Sekuritas |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investment, Mc Graw Hill, 2005 2. Kane, Body., Investment, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-2** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Risk - Uncertain Outcomes 2. Risky Investments with Risk-Free 3. Risk Aversion & Utility 4. Risk Aversion and Value: 5. Utility and Indifference Curves 6. Indifference Curves 7. Expected Return 8. Variance of Return 9. Portfolio Risk with Risk Free Asset 10. Portfolio Risk 11. Allocating Capital: Risky & Risk free Assets |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | Capital Allocation Between the Risky and The Risk-Free Asse |
| Metode/Model Pembelajaran | Kuliah Interaksi Aktif antara dosen dan mahasiswa |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | 1. Paper and pencil product 2. Partisipasi dan keaktifan |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-3** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Risk Reduction with Diversification 2. Two-Security Portfolio: Return & Risk 3. Portfolios with Different Correlations 4. Risk and Return: Minimum Variance |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | Optimal Risky Portfolios |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-4** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Capital Asset Pricing Model (CAPM) 2. Capital Market Line 3. Return and Risk for Individual Securities Security Market Line 4. Advantages of the Single Index Model 5. Single Factor Model 6. Risk Premium Format 7. Security Characteristic Line |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | 1. Capital Asset Pricing Model (CAPM) 2. Index Models |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-5** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Single Factor Model 2. Single Factor Model Equation 3. Multifactor Models 4. Multifactor Model Equation 5. Arbitrage Pricing Theory 6. Portfolios and Individual Security |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | 1. Arbitrage Pricing Theory and 2. Multifactor Models of Risk and Return |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-6** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Efficient Market Hypothesis (EMH) 2. Random Price Changes 3. Types of Stock Analysis 4. Market Efficiency & Portfolio Management |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | 1. Efficient Market Hypothesis (EMH) 2. Random Walk with Positive Trend 3. Random Price Changes |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-7** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Overview of Investigation Tests of the Single Factor Model 2. Tests of the Multifactor Model 3. Anomalies Literature 4. Fama-French Three Factor Model 5. Time-Varying Volatility |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) | 1. Measurement Error in Beta 2. Anomalies Literature |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-8** | Ujian Tengah Semester |
| **Pertemuan Ke-9** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Bond Characteristics 2. Different Issuers of Bonds 3. Provisions of Bonds 4. Bond Pricing 5. Bond Prices and Yields 6. Prices and Coupon Rates |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-10** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Theories of Term Structure 2. Expectations Theory 3. Liquidity Premium Theory 4. Liquidity Premiums and Yield Curves 5. Market Segmentation and Preferred Habitatmenjelaskan strategi tempat / distribusi |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-11** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Bond Pricing Relationships 2. Duration 3. Passive Management 4. Active Management: Swapping Strategies 5. Contingent Immunization 6. Interest Rate Swap |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw - Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-12** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | Mampu Framework of Analysis ϖ Global Economic Considerations ϖ Key Economic Variables ϖ Business Cycles ϖ Industry Analysisstrategi promosi |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw - Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-13** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Models of Equity Valuation 2. Intrinsic Value and Market Price 3. Dividend Discount Models: General Model 4. No Growth Model 5. Constant Growth Model 6. Estimating Dividend Growth Rates 7. Specified Holding Period Model 8. Growth & No Growth Components of Value 9. Price Earnings Ratios |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc Graw - Hill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-14** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Option Terminology 2. Market and Exercise Price Relationships 3. Equity, Options & Leveraged Equity 4. Option Strategies |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-15** | |
| Kemampuan Khusus (Sub-CPMK) | 1. Option Values 2. Time Value of Options: Call 3. Replication of Payoffs and Option Values 4. Black-Scholes Option Valuation 5. Portfolio Insurance 6. Hedging on Mispriced Options 7. Profit Position on Hedged Put Portfolio |
| Indikator |  |
| Materi Pokok (Bahan Kajian) |  |
| Metode/Model Pembelajaran | 1. Ceramah 2. Diskusi (Tanya jawab) |
| Pengalaman Belajar |  |
| Penilaian | Paper and Pencil product |
| Waktu | 1150 menit |
| Referensi | 1. Jurnal Irwin, Investme nt, Mc GrawHill, 2005 2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010 |
| **Pertemuan Ke-16** | Ujian Akhir Semester |

|  |  |
| --- | --- |
| Mengetahui,  Ketua Program Studi,  Nadi Hernadi Moorcy, S.E., M.M.  NIK. 015004046 | Balikpapan, September 2021  Dosen Pengampu,  C. Prihandoyo, S.E., M.M.  NIK. |