|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **LOGO UNIBA** | **UNIVERSITAS BALIKPAPAN****FAKULTAS EKONOMI****PROGRAM STUDI S1 MANAJEMEN** | **Kode Dokumen** |
| **RENCANA PEMBELAJARAN SEMESTER (Mulai Angkatan 2021)** |
| **MATA KULIAH (MK)** | **KODE** | **Rumpun MK** | **BOBOT (sks)** | **SEMESTER** | **Tgl Penyusunan** |
| **INVESTMENT MANAGEMENT & PORTOFOLIO**  | 1064013649 |  | **T=3** | **P=0** | 6 | 15 Juli 2021 |
| **OTORISASI** | **Pengembang RPS** | **Koordinator RMK** | **Ketua PRODI** |
|  | Dr. Nurlia, S.E., M.M  | **Nadi Hernadi Moorcy, S.E., M.M** |
| **Capaian Pembelajaran (CP)** | **CPL-PRODI yang dibebankan pada MK**  |  |
| CPL 1 | Menginternalisasi nilai, norma, dan etika akademik. (S8) |
| CPL 2 | Menunjukkan sikap bertanggungjawab atas pekerjaan di bidang keahliannya secara mandiri. (S9) |
| CPL 3 | Menginternalisasi semangat kemandirian, kejuangan, dan kewirausahaan. (S10) |
| CPL 4 | 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) |
| CPL 5 | Mampu menunjukkan kinerja mandiri, bermutu, dan terukur (KU2) |
| CPL 6 | 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) |
| CPL 7 | 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) |
| CPL 8 | Mampu melakukan proses evaluasi diri terhadap kelompok kerja yang berada dibawah tanggung jawabnya, dan mampu mengelola pembelajaran secara mandiri. (KU8) |
| CPL 9 | 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) |
| CPL 10 | 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) |
| CPL 11 | Mampu mengambil keputusan manajerial yang tepat di berbagai bidang organisasi pada tingkat operasional, berdasarkan analisis data dan informasi pada fungsi organisasi. (KK5) |
| CPL 12 | 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)  |
| CPL 13 | Menguasai prinsip kepemimpinan dan kewirausahaan dalam berbagai bidang organisasi. (P3) |
| CPL 14 | 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 (CPMK)** |
| CPMK 1 | P2 Mampu menerapkan instrumen analisis bisnis dan manajemen dengan mempertimbangkan aspek etika dan profesionalitas. |
| CPMK 2 | P4 Mampu menerapkan prinsip-prinsip kepemimpinan dan kewirausahaan ke dalam organisasi dengan mempertimbangkan nilai-nilai etika dan moral |
|  | **Kemampuan akhir tiap tahapan belajar (Sub-CPMK)** |  |
| Sub-CPMK 1 | 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
 |
| Sub-CPMK 2 | 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 Asset
 |
| Sub-CPMK 3 | 1. Risk Reduction with Diversification
2. Two-Security Portfolio: Return & Risk
3. Portfolios with Different Correlations
4. Risk and Return: Minimum Variance
 |
| Sub-CPMK 4 | 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
 |
| Sub-CPMK 5 | 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
 |
| Sub-CPMK 6 | 1. Efficient Market Hypothesis (EMH)
2. Random Price Changes
3. Types of Stock Analysis
4. Market Efficiency & Portfolio Management
 |
| Sub-CPMK 7 | 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
 |
| Sub-CPMK 8 | UTS |
| Sub-CPMK 9 | 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
 |
| Sub-CPMK 10 | 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
 |
| Sub-CPMK 11 | 1. Bond Pricing Relationships
2. Duration
3. Passive Management
4. Active Management: Swapping Strategies
5. Contingent Immunization
6. Interest Rate Swap
 |
| Sub-CPMK 12 | Mampu Framework of Analysis ϖ Global Economic Considerations ϖ Key Economic Variables ϖ Business Cycles ϖ Industry Analysisstrategi promosi |
| Sub-CPMK 13 | 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
 |
| Sub-CPMK 14 | 1. Option Terminology
2. Market and Exercise Price Relationships
3. Equity, Options & Leveraged Equity
4. Option Strategies
 |
| Sub-CPMK 15 | 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
 |
| Sub-CPMK 16 | UAS |
|  | **Korelasi CPMK dengan Sub CPMK:** |
| **Deskripsi Singkat MK** | Memahami konsep dasar manajemen portofolio serta berbagai instrumennya |
| **Bahan Kajian: Materi Pembelajaran** |   |
| **Pustaka** | **Utama :** |  |
|  |
| **Pendukung :** |  |
|  |
| **Dosen Pengampu** | Dr. Nurlia, S.E., M.M |
| **Matakuliah syarat** |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Mgg ke-** | **Kemampuan akhir tiap tahapan belajar (Sub-CPMK)** | **Penilaian** | **Bantuk Pembelajaran,Metode Pembelajaran, Penugasan Mahasiswa,** | **Materi Pembelajaran** | **Bobot Penilaian (%)** |
|  |  | **Indikator** | **Kriteria & Bentuk** | **Luring (*Online*)****(Metode Kognitif)** | **Daring (*offline)*** |  |  |
| **(1)** | **(2)** | **(3)** | **(4)** | **(5)** | **(6)** | **(7)** | **(8)** |
| **1** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | Materi:1. Investments & Financial Assets
2. Financial Instruments Perdagangan Sekuritas

Pustaka:1. Irwin, Investment, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investment, Wiley. 2010
 |  |
| **2** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | Materi:Capital Allocation Between the Risky and The Risk-Free AssePustaka:1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **3** | 1. Risk Reduction with Diversification
2. Two-Security Portfolio: Return & Risk
3. Portfolios with Different Correlations
4. Risk and Return: Minimum Variance
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | 1. **Materi:**Optimal Risky Portfolios

**Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 20051. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **4** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** 1. Capital Asset Pricing Model (CAPM)

Index Models**Pustaka:**1. . Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 20051. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **5** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** 1. Arbitrage Pricing Theory and
2. Multifactor Models of Risk and Return

**Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **6.** | 1. Efficient Market Hypothesis (EMH)
2. Random Price Changes
3. Types of Stock Analysis
4. Market Efficiency & Portfolio Management
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** 1. Efficient Market Hypothesis (EMH)
2. Random Walk with Positive Trend
3. Random Price Changes

**Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **7.** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** 1. Measurement Error in Beta
2. Anomalies Literature

**Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **8.** | UTS |  |  |  |  | **Materi:**  |  |
| **9.** | 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
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  |  CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **10.** | 1. Theories of Term Structure
2. Expectations Theory
3. Liquidity Premium Theory
4. Liquidity Premiums and Yield Curves
5. Market Segmentation and Preferred Habitatmenjelaskan strategi tempat / distribusi
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **11.** | 1. Bond Pricing Relationships
2. Duration
3. Passive Management
4. Active Management: Swapping Strategies
5. Contingent Immunization
6. Interest Rate Swap
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **12.** | Mampu Framework of Analysis ϖ Global Economic Considerations ϖ Key Economic Variables ϖ Business Cycles ϖ Industry Analysisstrategi promosi |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **13.** | 1. Models of Equity Valuation
2. Intrinsic Value and Market Price
3. Dividend Discount Models: General Model
4. No Growth Model
5. Constant Growth Model
6. Estimating Dividend Growth Rates
7. Specified Holding Period Model
8. Growth & No Growth Components of Value
9. Price Earnings Ratios
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **14.** | 1. Option Terminology
2. Market and Exercise Price Relationships
3. Equity, Options & Leveraged Equity
4. Option Strategies
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **15.** | 1. Option Values
2. Time Value of Options: Call
3. Replication of Payoffs and Option Values
4. Black-Scholes Option Valuation
5. Portfolio Insurance
6. Hedging on Mispriced Options
7. Profit Position on Hedged Put Portfolio
 |  | Bentuk Penilaian:Paper and Pencil product |  | CeramahDiskusi (Tanya jawab)1$×$150 menit | **Materi:** **Pustaka:**1. Irwin, Investme nt, Mc Graw Hill, 2005
2. Kane, Body., Investme nt, Wiley. 2010
 |  |
| **16.** | UAS |  | Bentuk Penilaian : Tes |  |  |  |  |

Balikpapan, 15 Agustus 2021

Ketua Program Studi Dosen Pengampu

S1 Manajemen

**Nadi Hernadi Moorcy, S.E., M.M   Dr. Nurlia, S.E., M.M**

**NIK. 015 004 046**  **NIDN. 1119118501**

**Catatan :**

1. **Capaian Pembelajaran Lulusan PRODI (CPL-PRODI)** adalah kemampuan yang dimiliki oleh setiap lulusan PRODI yang merupakan internalisasi dari sikap, penguasaan pengetahuan dan ketrampilan sesuai dengan jenjang prodinya yang diperoleh melalui proses pembelajaran.
2. **CPL yang dibebankan pada mata kuliah** adalah beberapa capaian pembelajaran lulusan program studi (CPL-PRODI) yang digunakan untuk pembentukan/pengembangan sebuah mata kuliah yang terdiri dari aspek sikap, ketrampulan umum, ketrampilan khusus dan pengetahuan.
3. **CP Mata kuliah (CPMK)** adalah kemampuan yang dijabarkan secara spesifik dari CPL yang dibebankan pada mata kuliah, dan bersifat spesifik terhadap bahan kajian atau materi pembelajaran mata kuliah tersebut.
4. **Sub-CP Mata kuliah (Sub-CPMK)** adalah kemampuan yang dijabarkan secara spesifik dari CPMK yang dapat diukur atau diamati dan merupakan kemampuan akhir yang direncanakan pada tiap tahap pembelajaran, dan bersifat spesifik terhadap materi pembelajaran mata kuliah tersebut.
5. **Indikator penilaian** kemampuan dalam proses maupun hasil belajar mahasiswa adalah pernyataan spesifik dan terukur yang mengidentifikasi kemampuan atau kinerja hasil belajar mahasiswa yang disertai bukti-bukti.
6. **Kreteria Penilaian** adalah patokan yang digunakan sebagai ukuran atau tolok ukur ketercapaian pembelajaran dalam penilaian berdasarkan indikator-indikator yang telah ditetapkan. Kreteria penilaian merupakan pedoman bagi penilai agar penilaian konsisten dan tidak bias. Kreteria dapat berupa kuantitatif ataupun kualitatif.
7. **Bentuk penilaian:** tes dan non-tes.
8. **Bentuk pembelajaran:** Kuliah, Responsi, Tutorial, Seminar atau yang setara, Praktikum, Praktik Studio, Praktik Bengkel, Praktik Lapangan, Penelitian, Pengabdian Kepada Masyarakat dan/atau bentuk pembelajaran lain yang setara.
9. **Metode Pembelajaran:** Small Group Discussion, Role-Play & Simulation, Discovery Learning, Self-Directed Learning, Cooperative Learning, Collaborative Learning, Contextual Learning, Project Based Learning, dan metode lainnya yg setara.
10. **Materi Pembelajaran** adalah rincian atau uraian dari bahan kajian yg dapat disajikan dalam bentuk beberapa pokok dan sub-pokok bahasan.
11. **Bobot penilaian** adalah prosentasi penilaian terhadap setiap pencapaian sub-CPMK yang besarnya proposional dengan tingkat kesulitan pencapaian sub-CPMK tsb., dan totalnya 100%.
12. TM=Tatap Muka, PT=Penugasan terstruktur, BM=Belajar mandiri