

Министерство науки и высшего образования РФ  
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение  
высшего образования  
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»

**СОГЛАСОВАНО**

**Заведующий кафедрой**

**Кафедра экономики и  
управления бизнес-процессами**

наименование кафедры

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий ОП ВО

**УТВЕРЖДАЮ**

**Заведующий кафедрой**

**Кафедра экономики и управления  
бизнес-процессами**

наименование кафедры

**З.А. Васильева**

подпись, инициалы, фамилия

«\_\_\_» \_\_\_\_\_ 20\_\_ г.

институт, реализующий дисциплину

**РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ  
УПРАВЛЕНИЕ ФИНАНСОВЫМ  
ПОРТФЕЛЕМ**

Дисциплина Б1.В.ДВ.14.03 Управление финансовым портфелем

Направление подготовки /  
специальность

Направленность  
(профиль)

Форма обучения

Год набора

очно-заочная

2021

Красноярск 2021

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

составлена в соответствии с Федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования с учетом профессиональных стандартов по укрупненной группе

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

---

Направление подготовки /специальность (профиль/специализация)

38.03.02 Менеджмент

---

Программу  
составили \_\_\_\_\_

## **1 Цели и задачи изучения дисциплины**

### **1.1 Цель преподавания дисциплины**

Дисциплина «Управление финансовым портфелем» является одной из дисциплин по выбору вариативной части программы подготовки бакалавров по направлению 38.03.02 Менеджмент.

Предметом изучения является практика и проблемы управления портфелем ценных бумаг.

Цель изучения дисциплины «Управление финансовым портфелем» - формирование у бакалавров теоретических знаний и практических навыков в области управления финансовым портфелем для принятия грамотных инвестиционных решений.

### **1.2 Задачи изучения дисциплины**

Основными задачами изучения дисциплины «Управление финансовым портфелем» являются:

- формирование знаний о портфельном инвестировании;
- освоение основных приемов эффективного управления финансовым портфелем.

1.3 Перечень планируемых результатов обучения по дисциплине (модулю), соотнесенных с планируемыми результатами освоения образовательной программы

<b>ПК-8:Способен принимать обоснованные решения по соответствию программ и проектов планам стратегического развития организации и интересам заинтересованных сторон и планировать процесс их реализации</b>
---

<b>ПК-8.1:Знать основы макро- и микроэкономики, финансовой математики, теории вероятности и математической статистики, оценки рисков, стратегического менеджмента, процессы управления программами и проектами</b>
--

<b>ПК-8.2:Уметь анализировать источники финансирования проектов и программ, оценивать их финансовые потоки и обязательные платежи, планировать управление их содержанием, эффективностью и оценкой рисков</b>
---

<b>ПК-8.3:Владеть инструментами разработки алгоритмов, моделей, схем финансирования проектов и программ, выявления и оценки рисков, экономическими методами прогнозирования развития рынков на кратко-, средне- и долгосрочную перспективу, процессами разработки мероприятий по управлению рисками проектов и программ, подготовки управленческой документации</b>
---

1.4 Место дисциплины (модуля) в структуре образовательной программы

Дисциплина «Управление финансовым портфелем» - одна из дисциплин по выбору вариативной части программы подготовки бакалавров по направлению 38.03.02 Менеджмент.

Предшествующие дисциплины учебного плана подготовки бакалавров, необходимые для освоения дисциплины Управление финансовым портфелем: Макроэкономика, Микроэкономика, Финансовый учет, Финансовые стратегии, Финансовые технологии, Финансовый менеджмент, Финансовое планирование, Финансовая аналитика, Цифровые технологии управления финансовыми рисками, Управление стоимостью компании.

#### 1.5 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется без применения ЭО и ДОТ.

## 2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	Семестр
		10
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>4 (144)</b>	<b>4 (144)</b>
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>0,83 (30)</b>	<b>0,83 (30)</b>
занятия лекционного типа	0,28 (10)	0,28 (10)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	0,56 (20)	0,56 (20)
практикумы		
лабораторные работы		
другие виды контактной работы		
в том числе: групповые консультации		
индивидуальные консультации		
иная внеаудиторная контактная работа:		
групповые занятия		
индивидуальные занятия		
<b>Самостоятельная работа обучающихся:</b>	<b>2,17 (78)</b>	<b>2,17 (78)</b>
изучение теоретического курса (ТО)		
расчетно-графические задания, задачи (РГЗ)		
реферат, эссе (Р)		
курсовое проектирование (КП)	Нет	Нет
курсовая работа (КР)	Нет	Нет
<b>Промежуточная аттестация (Экзамен)</b>	<b>1 (36)</b>	<b>1 (36)</b>

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

#### 3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа (акад. час)	Занятия семинарского типа		Самостоятельная работа, (акад. час)	Формируемые компетенции
			Семинары и/или Практические занятия (акад. час)	Лабораторные работы и/или Практикумы (акад. час)		
1	2	3	4	5	6	7
1	Методологические основы портфельного инвестирования	3	6	0	0	
2	Методы и модели формирования финансового портфеля	5	10	0	0	
3	Инвестиционные стратегии и управление финансовым портфелем	4	8	0	0	
4	Методы портфельного анализа	3	6	0	0	
5	Оценка эффективности управления финансовым портфелем	3	6	0	0	
Всего		18	36	0	0	

#### 3.2 Занятия лекционного типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1		3	0	0

2	2		5	0	0
3	3		4	0	0
4	4		3	0	0
5	5		3	0	0
Всего			15	0	0

### 3.3 Занятия семинарского типа

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
1	1		6	0	0
2	2		10	0	0
3	3		8	0	0
4	4		6	0	0
5	5		6	0	0
Всего			36	0	0

### 3.4 Лабораторные занятия

№ п/п	№ раздела дисциплины	Наименование занятий	Объем в акад. часах		
			Всего	в том числе, в инновационной форме	в том числе, в электронной форме
Всего					

## 5 Фонд оценочных средств для проведения промежуточной аттестации

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

## 6 Перечень основной и дополнительной учебной литературы, необходимой для освоения дисциплины (модуля)

6.1. Основная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л1.1	Шапкин А. С.	Управление портфелем инвестиций ценных бумаг	Москва: Издательско-торговая корпорация "Дашков и К", 2010

Л1.2	Шапкин А. С., Шапкин В. А.	Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций	Москва: Издательско- торговая корпорация "Дашков и К", 2012
6.2. Дополнительная литература			
	Авторы, составители	Заглавие	Издательство, год
Л2.1	Соколова О. В.	Финансы и кредит: Учебник	Москва: Издательство "Магистр", 2011

## **8 Методические указания для обучающихся по освоению дисциплины (модуля)**

Учебным планом на самостоятельную работу предусмотрено 54 часа. Содержание самостоятельной работы включает изучение теоретических материалов курса (36 часов) и подготовку рефератов (18 часов). Самостоятельная работа студентов регламентируется графиком учебного процесса и самостоятельной работы.

Для выполнения самостоятельной работы рекомендуются к использованию:

- Гражданский кодекс Российской Федерации (часть первая) от 30.11.1994 N 51-ФЗ (ред. от 03.08.2018) (с изм. и доп., вступ. в силу с 01.01.2019), Глава 7. Ценные бумаги  
[http://www.consultant.ru/document/cons\\_doc\\_LAW\\_5142/df1090e083c12a900212f0dbe9544032ce9cb991/](http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_5142/df1090e083c12a900212f0dbe9544032ce9cb991/)

- Федеральный закон от 22.04.1996 N 39-ФЗ (ред. от 27.12.2018) "О рынке ценных бумаг".  
[http://www.consultant.ru/document/cons\\_doc\\_LAW\\_10148/](http://www.consultant.ru/document/cons_doc_LAW_10148/)

- информационно-аналитические материалы, размещенные на сайтах российских и зарубежных компаний, материалы информационных агентств, статистические данные, бухгалтерской и финансовой отчетности компаний;

- основные нормативные документы, учебная, научная и справочная литература, ресурсы Интернета (разделы 6,7).

Подготовка рефератов предполагает самостоятельное изучение и изложение по установленной форме вопросов дисциплины. В процессе выполнения рефератов студент не только закрепляет, но и углубляет полученные теоретические знания.

К реферату как к самостоятельному исследованию предъявляются следующие требования:

- реферат должен быть написан самостоятельно на достаточно высоком теоретическом уровне с привлечением законодательных,



нормативных и др. документов;

- работа должна отличаться критическим подходом к действующей методологической базе учета и отчетности;

- работа должна быть написана четким и грамотным языком и правильно оформлена, т.е. должна иметь титульный лист, оглавление, введение и заключение, нумерацию страниц, список использованной литературы, презентационные материалы.

Основные требования к оформлению работы приведены в Стандарте СТО 4.2-07-2014 «Система менеджмента качества. Общие требования к построению, изложению и оформлению документов учебной деятельности» [Электронный ресурс] // Документы СФУ – Режим доступа: <http://www.sfu-kras.ru/node/8127>.

## **9 Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине (модулю) (при необходимости)**

### **9.1 Перечень необходимого программного обеспечения**

9.1.1	Для изучения настоящей дисциплины обучающимся необходимо наличие доступа к информационно-телекоммуникационной сети «Интер-нет».
9.1.2	Программные продукты, используемые в учебном процессе:
9.1.3	- Microsoft Office Professional Plus 2007;
9.1.4	- Microsoft Windows 7,8,10;
9.1.5	- Microsoft Visio 2007.

### **9.2 Перечень необходимых информационных справочных систем**

9.2.1	1. Справочная правовая система «КонсультантПлюс» [Электронный ресурс] - Режим доступа: <a href="http://www.consultant.ru">http://www.consultant.ru</a> .
9.2.2	2. Информационно-правовой портал «Гарант» [Электронный ресурс] - Режим доступа: <a href="http://www.garant.ru">http://www.garant.ru</a> .
9.2.3	

## **10 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)**

Для организации образовательного процесса используются:

- лекционные аудитории с мультимедийным оборудованием, включая проекционную и аудиотехнику;
- мультимедийные аудитории для практических занятий, оснащенные моделируемой мебелью, мультимедийным проектором;
- презентационные комплексы Smart Board, Inter Write, установленные стационарно во всех лабораторных аудиториях;
- компьютерные классы с выделенным выходом в Интернет на 15-20

рабочих мест.

Освоение дисциплины инвалидами и лицами с ограниченными возможностями здоровья, в зависимости от нозологий, осуществляется с использованием средств обучения общего и специального назначения.