

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 38.03.02 Менеджмент

Направленность  
(профиль)

Форма обучения

очная

Год набора

2019

Красноярск 2021

## **РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ**

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

380000 «ЭКОНОМИКА И УПРАВЛЕНИЕ»

---

Направление подготовки /специальность (профиль/специализация)

Направление 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 навы-ков в области управления финансовым портфелем для принятия грамот-ных 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-6: способностью участвовать в управлении проектом, программой внедрения технологических и продуктовых инноваций или программой организационных изменений</b>
--

<b>ПК-7: владением навыками поэтапного контроля реализации бизнес-планов и условий заключаемых соглашений, договоров и контрактов/ умением координировать деятельность исполнителей с помощью методического инструментария реализации управленческих решений в области функционального менеджмента для достижения высокой согласованности при выполнении конкретных проектов и работ</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
		8
<b>Общая трудоемкость дисциплины</b>	<b>4 (144)</b>	<b>4 (144)</b>
<b>Контактная работа с преподавателем:</b>	<b>1,5 (54)</b>	<b>1,5 (54)</b>
занятия лекционного типа	0,5 (18)	0,5 (18)
занятия семинарского типа		
в том числе: семинары		
практические занятия	1 (36)	1 (36)
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>1,5 (54)</b>	<b>1,5 (54)</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.