

Министерство науки и высшего образования РФ
Федеральное государственное автономное образовательное учреждение
высшего образования
«СИБИРСКИЙ ФЕДЕРАЛЬНЫЙ УНИВЕРСИТЕТ»
РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Б1.В.ДВ.14.03 Управление финансовым портфелем

наименование дисциплины (модуля) в соответствии с учебным планом

Направление подготовки / специальность

38.03.02 Менеджмент

Направленность (профиль)

38.03.02 Менеджмент

Форма обучения

очная

Год набора

2021

Красноярск 2023

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ (МОДУЛЯ)

Программу составили _____

Доктор экономических наук, Профессор, Каячев Геннадий Федорович

должность, инициалы, фамилия

1 Цели и задачи изучения дисциплины

1.1 Цель преподавания дисциплины

Цель дисциплины:

- сформировать у студентов системное представление о сущности, методах и инструментах управления финансовым портфелем.

1.2 Задачи изучения дисциплины

- сформировать знания, навыки, необходимые для профессиональной деятельности в качестве финансового менеджера;

- сформировать понятийный аппарат в области управления финансовым портфелем;

- - приобрести навыки по работе с инструментарием управления финансовым портфелем.

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

Код и наименование индикатора достижения компетенции	Запланированные результаты обучения по дисциплине
ПК-8: Способность принимать обоснованные решения по соответствию программ и проектов планам стратегического развития организации и интересам заинтересованных сторон и планировать процесс их реализации	
ПК-8.1: Знать основы макро- и микроэкономики, финансовой математики, теории вероятности и математической статистики, оценки рисков, стратегического менеджмента, процессы управления программами и проектами	основы финансовой математики, оценки рисков использовать основы финансовой математики, оценки рисков инструментами финансовой математики, оценки рисков
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	источники финансирования проектов и программ анализировать источники финансирования проектов и программ инструментарием оценки финансовых потоков

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

1.4 Особенности реализации дисциплины

Язык реализации дисциплины: Русский.

Дисциплина (модуль) реализуется с применением ЭО и ДОТ

URL-адрес и название электронного обучающего курса: .

2. Объем дисциплины (модуля)

Вид учебной работы	Всего, зачетных единиц (акад.час)	е
		1
Контактная работа с преподавателем:	1,5 (54)	
занятия лекционного типа	0,5 (18)	
практические занятия	1 (36)	
Самостоятельная работа обучающихся:	1,5 (54)	
курсовое проектирование (КП)	Нет	
курсовая работа (КР)	Нет	
Промежуточная аттестация (Экзамен)	1 (36)	

3 Содержание дисциплины (модуля)

3.1 Разделы дисциплины и виды занятий (тематический план занятий)

		Контактная работа, ак. час.							
№ п/п	Модули, темы (разделы) дисциплины	Занятия лекционного типа		Занятия семинарского типа				Самостоятельная работа, ак. час.	
				Семинары и/или Практические занятия		Лабораторные работы и/или Практикумы			
		Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС	Всего	В том числе в ЭИОС
1. Финансовый портфель; понятие, необходимость и цели управления									
	1. Финансовый портфель; понятие, необходимость и цели управления	4							
	2. Финансовый портфель; понятие, необходимость и цели управления			8					
	3. Финансовый портфель; понятие, необходимость и цели управления							8	
2. Методы и инструменты управления финансовым портфелем									
	1. Методы и инструменты управления финансовым портфелем	4							
	2. Методы и инструменты управления финансовым портфелем			8					
	3. Методы и инструменты управления финансовым портфелем							16	
3. Принципы и особенности инвестирования в условиях высокой волатильности финансовых рынков									

1. Принципы и особенности инвестирования в условиях высокой волатильности финансовых рынков	2							
2. Принципы и особенности инвестирования в условиях высокой волатильности финансовых рынков							16	
3. Принципы и особенности инвестирования в условиях высокой волатильности финансовых рынков			4					
4. Оценка и выбор стратегии управления финансовым портфелем								
1. Оценка и выбор стратегии управления финансовым портфелем			8					
2. Оценка и выбор стратегии управления финансовым портфелем	4							
3. Оценка и выбор стратегии управления финансовым портфелем							10	
5. Реализация стратегии управления финансовым портфелем								
1. Реализация стратегии управления финансовым портфелем	4							
2. Реализация стратегии управления финансовым портфелем			8					
3. Реализация стратегии управления финансовым портфелем							4	
Всего	18		36				54	

4 Учебно-методическое обеспечение дисциплины

4.1 Печатные и электронные издания:

1. Лапыгин Ю. Н. Стратегический менеджмент: Учебное пособие(Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
2. Сироткин С.А., Кельчевская Н.Р. Стратегический менеджмент: Учебник (Москва: ООО "Научно-издательский центр ИНФРА-М").
3. Савченко А. Б. Стратегический менеджмент: Учебное пособие(Москва: Издательский Центр РИО□).
4. Левушкина С. В. Стратегический менеджмент: учебное пособие (Ставрополь: СтГАУ).

4.2 Лицензионное и свободно распространяемое программное обеспечение, в том числе отечественного производства (программное обеспечение, на которое университет имеет лицензию, а также свободно распространяемое программное обеспечение):

1. Программы, обеспечивающие презентации, демонстрации слайдовых материалов в ходе защиты рефератов (MicrosoftOfficePowerPoint);
2. Программы представления текстового материала (MicrosoftOfficeWord);
3. Программы представления статистического материала и его первичной статистической обработки (MicrosoftOfficeExcel);.

4.3 Интернет-ресурсы, включая профессиональные базы данных и информационные справочные системы:

1. Перечень информационных технологий, используемых при осуществлении образовательного процесса по дисциплине
2. Каждый обучающийся обеспечен доступом к электронно-библиотечной системе, содержащей издания по изучаемой дисциплине и сформированной по согласованию с правообладателями учебной и учебно-методической литературы.
3. Электронное средство обучения Moodle, URL адрес <http://study.sfu-kras.ru/login/index.php>.
4. Поисковые системы: Google или Яндекс
5. Электронно-библиотечная система обеспечивает возможность индивидуального доступа для каждого обучающегося из любой точки, в которой имеется доступ к сети Интернет Научная библиотека СФУ <http://bik.sfu-kras.ru/>
6. Словари. ру. – Режим доступа: <http://slovari.ru/dictsearch>
7. Электронно-библиотечная система «Лань»: <http://e.lanbook.com>
8. Электронно-библиотечная система "ИНФРА-М": <http://www.znaniy.com>
9. Электронная библиотека диссертаций (ЭБД) РГБ: <http://dvs.rsl.ru> (доступ к полному тексту), <http://diss.rsl.ru> (доступ к каталогу)
10. ЭБ Издательского дома «Гребенников»: <http://grebennikon.ru>
11. Научная электронная библиотека (eLIBRARY.RU): <http://elibrary.ru>

12. Государственный архив Красноярского края (ГАКК): <http://красноярские-архивы.рф>
13. ИАС «Статистика»: <http://www.ias-stat.ru>
14. Электронная библиотека «Гумер» – Режим доступа: <http://www.gumer.info/>
15. Электронная библиотека «Куб» – Режим доступа: <http://www.koob.ru/>
- 16.
- 17.
- 18.

5 Фонд оценочных средств

Оценочные средства находятся в приложении к рабочим программам дисциплин.

6 Материально-техническая база, необходимая для осуществления образовательного процесса по дисциплине (модулю)

Характеристика аудиторий, оборудования, технических средств обучения, используемых в программе:

- лекционные аудитории с мультимедийным оборудованием, включая проекционную и аудиотехнику;
- мультимедийные аудитории для практических занятий;
- презентационные комплексы, установленные стационарно во всех аудиториях.