

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

2020

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 |
|--|---|
| <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 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,<br>зачетных<br>единиц<br>(акад.час) | е |
|--|--|---|
|  |  | 1 |
| <b>Контактная работа с преподавателем:</b> | <b>1,5 (54)</b>                            |   |
| занятия лекционного типа                   | 0,5 (18)                                   |   |
| практические занятия                       | 1 (36)                                     |   |
| <b>Самостоятельная работа обучающихся:</b> | <b>1,5 (54)</b>                            |   |
| курсовое проектирование (КП)               | Нет  |   |
| курсовая работа (КР)                       | Нет  |   |
| <b>Промежуточная аттестация (Экзамен)</b>  | <b>1 (36)</b>                              |   |

### 3 Содержание дисциплины (модуля)

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

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

|   |    |  |    |  |  |  |    |  |
|---|----|--|----|--|--|--|----|--|
| 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  |  |  |  |    |  |
| <b>4. Оценка и выбор стратегии управления финансовым портфелем</b>                          |    |  |    |  |  |  |    |  |
| 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 |  |
| <b>5. Реализация стратегии управления финансовым портфелем</b>                              |    |  |    |  |  |  |    |  |
| 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.znaniium.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.