

Межгосударственное образовательное учреждение высшего образования  
«Белорусско-Российский университет»

УТВЕРЖДАЮ  
Первый проректор Белорусско-  
Российского университета  
Ю.В. Малин

«22» 06 2012г.  
Регистрационный № УД-\_\_\_\_\_ /р

СОВРЕМЕННАЯ ПОРТФЕЛЬНАЯ ТЕОРИЯ В СИСТЕМЕ УПРАВЛЕНИЯ  
КОРПОРАТИВНЫМИ ФИНАНСАМИ

РАБОЧАЯ ПРОГРАММА ДИСЦИПЛИНЫ

Направление подготовки 38.04.08 ФИНАНСЫ И КРЕДИТ

Направленность (профиль) Корпоративные финансы в цифровой экономике

Квалификация Магистр

	Форма обучения	
	Очная	Заочная
Курс	2	2
Семестр	3	4
Лекции, часы	8	2
Практические занятия, часы	34	8
Зачёт, семестр	3	4
Контактная работа по учебным занятиям, часы	42	10
Самостоятельная работа, часы	66	98
Всего часов /зачетных единиц	108/3	108/3

Кафедра-разработчик программы: Финансы и бухгалтерский учет

Составитель: Бальчевская О.В

Могилев, 2021

Рабочая программа составлена в соответствии с федеральным государственным образовательным стандартом высшего образования – магистратура по направлению подготовки 38.04.08 Финансы и кредит, утвержденным приказом № 991 от 12.08.2020 г., учебным планом рег. № 380408-2, утвержденным 01.03.2021 г.

Рассмотрена и рекомендована к утверждению кафедрой «Финансы и бухгалтерский учет» 16.03.2021 г., протокол № 13.

Зав. кафедрой  М.С. Александрёнок

Одобрена и рекомендована к утверждению Научно-методическим советом  
Белорусско-Российского университета  
«16» июня 2021 г., протокол № 7.

Зам. председателя  
Научно-методического совета  
Белорусско-Российского университета

 С.А. Сухоцкий

Рецензент:

Жесткова Елена Сергеевна – заведующая кафедрой «Экономика и управление» УО «Могилевский государственный университет им. А.А. Кулешова», кандидат экономических наук, доцент

Рабочая программа согласована:

Ведущий библиотекарь

Начальник учебно-методического отдела

 В.А. Кемова  
«18» «05» 2021 г.

# 1 ПОЯСНИТЕЛЬНАЯ ЗАПИСКА

## 1.1 Цель учебной дисциплины

Целью учебной дисциплины является формирование у будущих магистров системы знаний основных положений современной портфельной теории и выработка практических навыков по ее применению при принятии корпоративных инвестиционных решений.

## 1.2 Планируемые результаты изучения дисциплины

В результате освоения учебной дисциплины студент должен

### **знать:**

- методологию портфельной теории в системе управления корпоративными финансами;
- основы организации абстрактного мышления, анализа и синтеза инвестора при формировании портфельных бумаг;
- действия в нестандартных ситуациях, нести ответственность за принятые решения;
- способы выявления финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов.

### **уметь:**

- применять современную портфельную теорию исходя из возможности формирования портфеля инвестиций из реальных и финансовых активов в условиях трансформации финансовых рынков;
- изучать современную ситуацию на финансовом рынке, на основе сделанных выводов проводить суждение и умозаключение о формировании портфельной стратегии в системе управления корпоративными финансами;
- действовать и нести ответственность за принятые решения в нестандартных ситуациях;
- проводить исследование финансово-экономических рисков в деятельности хозяйствующих субъектов;
- самостоятельно приобретать и совершенствовать знания и профессиональные навыки.

### **владеть:**

- методами применения финансовых инструментов в системе управления корпоративными финансами в условиях трансформации финансовых рынков;
- навыками постановки цели, способностью в устной и письменной речи логически оформить результаты мышления о современной портфельной теории в системе управления корпоративными финансами;
- методологией действий в нестандартных ситуациях и ответственности за принятые решения;
- методами для разработки системы управления рисками при их выявлении в деятельности хозяйствующих субъектов.

## 1.3 Место дисциплины в системе подготовки студента

Дисциплина относится к обязательной части блока Б1.

Перечень учебных дисциплин, изучаемых ранее, усвоение которых необходимо для изучения данной дисциплины:

- «Корпоративное право (финансовый аспект)»;
- «Финансовые технологии»;
- «Финансы организаций в цифровой экономике».

Результаты изучения дисциплины используются в ходе практики и при подготовке выпускной квалификационной работы.

## 1.4 Требования к освоению учебной дисциплины

Освоение данной учебной дисциплины должно обеспечивать формирование следующих компетенций:

Коды формируемых компетенций	Наименования формируемых компетенций
ОПК-4	Способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности ОПК-4.3. Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений
ПК-3	Способен осуществлять подготовку финансового обоснования проектов и программ развития, проектов финансовых планов /прогнозов и бюджетов организаций и органов государственной власти и местного самоуправления, а также разрабатывать проекты методических материалов, предложений и мероприятий по реализации проектов и программ ПК-3.2. Умеет выбирать методы финансового обеспечения реализации проектов и программ развития организаций и органов государственной власти и местного самоуправления
ПК-6	Способен идентифицировать и концептуально формировать корпоративную систему управления рисками в условиях развития Финтех ПК-6.1. Идентифицирует и оценивает риски в целях оптимизации корпоративного риск-менеджмента

## 2 СТРУКТУРА И СОДЕРЖАНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

Вклад дисциплины в формирование результатов обучения выпускника (компетенций) и достижение обобщенных результатов обучения происходит путем освоения содержания обучения и достижения частных результатов обучения, описанных в данном разделе.

### 2.1 Содержание учебной дисциплины

Номер темы	Наименование темы	Содержание	Коды формируемых компетенций
1	Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	Инвестиционная деятельность на фондовом рынке, ее задачи и функции. Структура инвестиций и их виды. Особенности финансовых инвестиций. Основы определения инвестиционного риска. Методы управления инвестиционными рисками.	ОПК-4
2	Классическая портфельная теория	Портфель Марковица минимального риска, портфель Тобина минимального риска, портфель Марковица и Тобина максимальной эффективности.	ПК-3
3	Современные технологии формирования портфеля	Мониторинг (ревизия) и диверсификация фондового портфеля. Формирование оптимального портфеля ценных бумаг в зависимости от рисков-доходного типа инвестора. Модели управления портфелем. Применение моделей стоимости опционов в управлении финансами фирмы.	ПК-3
4	Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	Эффективный фронт и эффективные портфели. Повышение доходности портфеля (стратегии "cash&carry").	ПК-6
5	Оценка эффективности управления портфелем	Оптимизация фондовых портфелей с использованием нечетко-множественных описаний.	ПК-3 ПК-6

### 2.2 Учебно-методическая карта учебной дисциплины для очной формы обучения

№ недели	Лекции (наименование тем)	Практические занятия					Форма контроля знаний	
		Часы	Часы	Лабораторные занятия	Часы	Самостоятельная работа, часы		
1	Тема 1. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	2	Пр.р. 1. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	2			4	
2			Пр.р. 2. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	2			4	
3			Пр.р. 3. Инвестиционная деятельность на рынке	2			4	

			ценных бумаг					
4			Пр.р. 4. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	2			4	
5	Тема 2. Классическая портфельная теория	2	Пр.р. 5. Классическая портфельная теория	2			4	
6			Пр.р. 6. Классическая портфельная теория	2			4	
7			Пр.р. 7. Классическая портфельная теория	2			4	
8			Пр.р. 8. Классическая портфельная теория	2			3	ЗИЗ
9	Тема 3. Современные технологии формирования портфеля Тема 4. Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	1 1	Пр.р. 9. Современные технологии формирования портфеля	2			4	
10			Пр.р. 10. Современные технологии формирования портфеля	2			4	
11			Пр.р. 11. Современные технологии формирования портфеля	2			4	
12			Пр.р. 12. Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	2			4	
13			Пр.р. 13. Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	2			4	
14			Пр.р. 14. Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	2			4	
15	Тема 5. Оценка эффективности управления портфелем	2	Пр.р. 15. Оценка эффективности управления портфелем	2			4	
16			Пр.р. 16. Оценка эффективности управления портфелем	2			4	ЗИЗ
17			Пр.р. 17. Оценка эффективности управления портфелем	2			3	ПА (зачет)
	Итого	8		34			66	

Принятые обозначения:

ЗИЗ - защита индивидуального задания.

ПА - промежуточная аттестация.

## 2.2 Учебно-методическая карта учебной дисциплины для заочной формы обучения

Лекции (наименование тем)	Часы	Практические занятия	Часы	Форма контроля знаний
Тема 5. Оценка эффективности управления портфелем	2	Пр.р. 1. Инвестиционная деятельность на рынке ценных бумаг	2	
		Пр.р. 5. Классическая портфельная теория	2	
		Пр.р. 9. Современные технологии формирования портфеля	2	ЗИЗ
		Пр.р. 12. Регулирование инвестиций и инвестиционной деятельности	2	ПА (зачет)
Всего	2		8	

Для самостоятельной подготовки студенты заочной формы обучения должны руководствоваться пунктом 2.1.

### 3 ОБРАЗОВАТЕЛЬНЫЕ ТЕХНОЛОГИИ

Применение инновационных форм и методов проведения занятий при изучении различных тем курса представлено в таблице:

№ п/п	Форма проведения занятия	Вид аудиторных занятий		Всего часов
		Лекции	Практические занятия	
1	Мультимедиа	Темы 1,2,3,4,5		8
2	Традиционные		№ 1-8	4
3	Расчетные		№ 9 - 17	30
	<b>Итого</b>	8	34	42

### 4 ОЦЕНОЧНЫЕ СРЕДСТВА

Используемые оценочные средства по учебной дисциплине представлены в таблице и хранятся на кафедре:

№ п/п	Вид оценочных средств	Количество комплектов
1	Вопросы к зачету	1
2	Перечень индивидуальных заданий	1

### 5 МЕТОДИКА И КРИТЕРИИ ОЦЕНКИ КОМПЕТЕНЦИЙ СТУДЕНТОВ

#### 5.1 Уровни сформированности компетенций

№ п/п	Уровни сформированности компетенции	Содержательное описание уровня	Результаты обучения
		ОПК-4. Способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности	
		ОПК-4.3. Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений	
1	Пороговый уровень	Понимает цели, задачи и результаты принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений на основе анализа инвестиционной деятельности организации.	Обладает навыками обоснования финансово-экономических и организационно-управленческих решений. Знает процедуру и порядок принятия решений в финансово-экономических и организационно-управленческих областях на основе результатов анализа инвестиционной деятельности организации.
2	Продвинутый уровень	Способен на основе мониторинга и диверсификации фондового портфеля формировать результаты принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений.	Умеет осуществлять выбор и диагностику результатов анализа на основе мониторинга и диверсификации фондового портфеля, а также обобщать результаты принимаемых управленческих решений. Имеет достаточный уровень владения навыками порядка принятия решений в финансово-экономических и организационно-управленческих областях на основе результатов анализа.
3	Высокий уровень	Умеет на профессиональном уровне применять приемы оптимизации фондовых портфелей с использованием нечетко-множественных описаний в финансово-экономические и организационно-управленческие решения	Владеет навыками выбора средств для обработки данных повышение доходности портфеля, самостоятельного обобщения и оценки результатов анализа управленческих решений. Способен контролировать результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений
		ПК-3. Способен осуществлять подготовку финансового обоснования проектов и программ развития, проектов финансовых планов /прогнозов и бюджетов организаций и органов государственной власти и местного самоуправления, а также разрабатывать проекты методических материалов, предложений и мероприятий по реализации проектов и программ	
		ПК-3.2. Умеет выбирать методы финансового обеспечения реализации проектов и программ развития организаций и органов государственной власти и местного самоуправления	

1	Пороговый уровень	Понимает механизм выбора методов финансового обеспечения реализации проектов и программ развития организаций	Обладает навыками осуществления сбора, анализа данных и обоснования методов финансового обеспечения реализации проектов инвестиционной деятельности на фондовом рынке. Знает порядок формирования программы развития организаций.
2	Продвинутый уровень	Способен на основе имеющихся данных анализа применения моделей стоимости опционов в управлении финансами фирмы подготовить финансовое обоснование проектов и программ развития, проектов финансовых планов, а также разрабатывать проекты методических материалов, предложений и мероприятий по реализации проектов и программ развития организаций	Умеет анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные данные; определяет обобщающие характеристики применения моделей стоимости опционов в управлении финансами фирмы для подготовки финансового обоснования проектов. Имеет достаточный уровень для строительства стандартных теоретических моделей портфелей Марковица и Тобина для разработки предложений и мероприятий по реализации проектов и программ развития организаций
3	Высокий уровень	Умеет грамотно на профессиональном уровне на основе методов финансового обеспечения реализации проектов осуществлять подготовку программ развития, проектов финансовых планов, предложений и мероприятий по реализации проектов и программ оптимизации фондовых портфелей.	Владеет навыками анализировать результаты расчетов и обосновывать выводы; определять обобщающие характеристики мониторинг (ревидии) и диверсификации фондового портфеля; строить на основе описания ситуаций стандартные модели финансового обеспечения проектов. Способен прогнозировать и оптимизировать фондовые портфели компании с целью разработки предложений и мероприятий по созданию проектов финансовых планов организаций.

ПК-6. Способен идентифицировать и концептуально формировать корпоративную систему управления рисками в условиях развития Финтех

ПК-6.1. Идентифицирует и оценивает риски в целях оптимизации корпоративного риск-менеджмента

1	Пороговый уровень	Понимает возможности и способы оценки рисков в формировании фондовых портфелей в системе внутрифирменных характеристик.	Обладает навыками использования финансовых инструментов, обслуживающих фондовые портфели компании. Знает способы оценки рисков в формировании рисково-доходного типа инвестора и их роль в определении стоимости компании.
2	Продвинутый уровень	Способен формировать системы целевых параметров организации моделей управления портфелем компании, с целью оценки рисков и оптимизации корпоративного риск-менеджмента	Умеет анализировать системы и методы планирования моделей управления портфелем компании, оценивать фондовые портфели с учетом факторов времени и инфляции. Имеет достаточный уровень для идентификации рисков при оценке стоимости опционов в управлении финансами фирмы.
3	Высокий уровень	Умеет использовать методы прогнозирования фондовых портфелей, с целью идентификации и концептуального формирования корпоративной системы управления рисками в условиях развития организации.	Владеет навыками выявления тренда повышения доходности портфеля в режиме реального времени. Способен прогнозировать оптимизацию фондовых портфелей с использованием нечетко-множественных описаний, с целью оценки рисков компании.

## 5.2 Методика оценки знаний, умений и навыков студентов

Результаты обучения	Оценочные средства
ОПК-4. Способен обосновывать и принимать финансово-экономические и организационно-управленческие решения в профессиональной деятельности	
ОПК-4.3. Контролирует результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений	
Обладает навыками обоснования финансово-экономических и организационно-управленческих решений. Знает процедуру и порядок принятия решений в финансово-экономических и организационно-управленческих областях на основе результатов анализа инвестиционной деятельности организации.	Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий

<p>Умеет осуществлять выбор и диагностику результатов анализа на основе мониторинга и диверсификации фондового портфеля, а также обобщать результаты принимаемых управленческих решений. Имеет достаточный уровень владения навыками порядка принятия решений в финансово-экономических и организационно-управленческих областях на основе результатов анализа.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>Владеет навыками выбора средств для обработки данных повышение доходности портфеля, самостоятельного обобщения и оценки результатов анализа управленческих решений. Способен контролировать результаты выполнения принимаемых финансово-экономических и организационно-управленческих решений</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>ПК-3. Способен осуществлять подготовку финансового обоснования проектов и программ развития, проектов финансовых планов /прогнозов и бюджетов организаций и органов государственной власти и местного самоуправления, а также разрабатывать проекты методических материалов, предложений и мероприятий по реализации проектов и программ</p>	
<p>ПК-3.2. Умеет выбирать методы финансового обеспечения реализации проектов и программ развития организаций и органов государственной власти и местного самоуправления</p>	
<p>Обладает навыками осуществления сбора, анализа данных и обоснования методов финансового обеспечения реализации проектов инвестиционной деятельности на фондовом рынке. Знает порядок формирования программы развития организаций.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>Умеет анализировать результаты расчетов и обосновывать полученные данные; определяет обобщающие характеристики применения моделей стоимости опционов в управлении финансами фирмы для подготовки финансового обоснования проектов. Имеет достаточный уровень для строительства стандартных теоретических моделей портфелей Марковица и Тобина для разработки предложений и мероприятий по реализации проектов и программ развития организаций</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>Владеет навыками анализировать результаты расчетов и обосновывать выводы; определять обобщающие характеристики мониторинг (ревизии) и диверсификации фондового портфеля; строить на основе описания ситуаций стандартные модели финансового обеспечения проектов. Способен прогнозировать и оптимизировать фондовые портфели компании с целью разработки предложений и мероприятий по созданию проектов финансовых планов организаций.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>ПК-6. Способен идентифицировать и концептуально формировать корпоративную систему управления рисками в условиях развития Финтех</p>	
<p>ПК-6.1. Идентифицирует и оценивает риски в целях оптимизации корпоративного риск-менеджмента</p>	
<p>Обладает навыками использования финансовых инструментов, обслуживающих фондовые портфели компании. Знает способы оценки рисков в формировании риск-доходного типа инвестора и их роль в определении стоимости компании.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>Умеет анализировать системы и методы планирования моделей управления портфелем компании, оценивать фондовые портфели с учетом факторов времени и инфляции. Имеет достаточный уровень для идентификации рисков при оценке стоимости опционов в управлении финансами фирмы.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>
<p>Владеет навыками выявление тренда повышения доходности портфеля в режиме реального времени. Способен прогнозировать оптимизацию фондовых портфелей с использованием нечетко-множественных описаний, с целью оценки рисков компании.</p>	<p>Перечень вопросов и заданий к практическим работам №1-17 Перечень вопросов к зачету Перечень индивидуальных заданий</p>

### 5.3 Критерии оценки практических работ

Оценка	Критерии
5 ("отлично")	Систематизированные, глубокие и полные знания по тематике выполняемой практической работы, а также по основным вопросам, выходящим за ее рамки. Точное использование научной терминологии. Умение ориентироваться в теориях, концепциях и направлениях, связанных с тематикой выполняемой практической работы, и давать им критическую оценку.
4 ("хорошо")	Достаточно полные и систематизированные знания по тематике выполняемой практической работы, использование научной терминологии. Умение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях, связанных с тематикой выполняемой практической работы, и давать им критическую оценку.
3 ("удовлетворительно")	Достаточный объем знаний по тематике выполняемой практической работы, минимально соответствующий требованиям образовательного стандарта, использование научной терминологии. Умение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях, связанных с тематикой выполняемой практической работы.
2 ("неудовлетворительно")	Недостаточно полный объем знаний по тематике выполняемой практической работы, не соответствующий минимальным требованиям, установленным образовательным стандартом. Неумение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях, связанных с тематикой выполняемой практической работы.

### 5.4 Критерии оценки индивидуального задания

Оценка	Критерии
5 ("отлично")	Работа отличается творческим подходом, собственным аргументированными выводами. Тема задания раскрыта исчерпывающе, автор продемонстрировал глубокие знания. Работа содержит достаточно полную информацию из разнообразных источников.
4 ("хорошо")	Работа самостоятельная, демонстрирующая серьезную заинтересованность автора, предпринята попытка представить личный взгляд на тему проекта, применены элементы творчества. Тема задания раскрыта, автор показал знание темы в рамках программы. Работа содержит достаточный объем информации из однотипных источников.
3 ("удовлетворительно")	Работа шаблонная. Автор не использовал возможности творческого подхода. Тема задания раскрыта фрагментарно. Работа содержит незначительный объем информации из ограниченного числа однотипных источников.
2 ("неудовлетворительно")	Тема задания не раскрыта, автор показал частичные знание темы в рамках программы. Работа содержит незначительный объем информации из ограниченного числа однотипных источников.

### 5.5 Критерии оценки зачета

Оценка	Критерии
«зачтено»	Систематизированные, глубокие и полные знания по всем разделам учебной программы, а также по основным вопросам, выходящим за ее пределы. Точное использование научной терминологии. Умение ориентироваться в теориях, концепциях и направлениях по изучаемой дисциплине и давать им критическую оценку. Достаточно полные и систематизированные знания по всем разделам учебной программы, использование научной терминологии. Умение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях по изучаемой дисциплине и давать им критическую оценку. Достаточный объем знаний в рамках образовательного стандарта, использование научной терминологии. Умение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях по изучаемой дисциплине и давать им оценку.
«не зачтено»	Недостаточно полный объем знаний в рамках образовательного стандарта. Неумение ориентироваться в основных теориях, концепциях и направлениях по изучаемой дисциплине.

## 6 МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОРГАНИЗАЦИИ И ВЫПОЛНЕНИЮ САМОСТОЯТЕЛЬНОЙ РАБОТЫ СТУДЕНТОВ ПО УЧЕБНОЙ ДИСЦИПЛИНЕ

Самостоятельная работа студентов (СРС) направлена на закрепление и углубление освоения учебного материала, развитие практических умений. СРС включает следующие виды самостоятельной работы студентов:

- исследовательская работа, в том числе научно-исследовательская;
- ответы на контрольные вопросы;
- подготовка сообщений к выступлению на практических занятиях;
- подготовка к зачету.

Перечень контрольных вопросов и заданий для самостоятельной работы студентов приведен в приложении и хранится на кафедре.

Для СРС рекомендуется использовать источники, приведенные в п. 7.

## 7 УЧЕБНО-МЕТОДИЧЕСКОЕ И ИНФОРМАЦИОННОЕ ОБЕСПЕЧЕНИЕ ДИСЦИПЛИНЫ

### 7.1 Основная литература

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания учебной литературы	Гриф	Количество экземпляров/ URL
1	Рыманов, А. Ю. Основы корпоративных финансов: Учеб. пособие / А.Ю. Рыманов [Электронный ресурс]. – М.: ИНФРА-М, 2020. – 150 с.	Рекомендовано УМС ВО в качестве учебного пособия для студентов высших учебных заведений обучающихся по направлениям подготовки 38.04.02 «Менеджмент», 38.04.01 «Экономика», 28.04.08 «Финансы и кредит» (квалификация (степень) «магистр»)	<a href="https://znanium.com/catalog/product/1074318">https://znanium.com/catalog/product/1074318</a>
2	Дудник, Д. В. Основы финансового анализа: Учеб. пособие / Д. В. Дудник, М. Л. Шер [Электронный ресурс]. – М.: РГУП, 2020. – 232 с.	–	<a href="https://znanium.com/catalog/product/1191363">https://znanium.com/catalog/product/1191363</a>

### 7.2 Дополнительная литература

№ п/п	Автор, название, место издания, издательство, год издания учебной литературы	Гриф	Количество экземпляров/ URL
1	Кумехов, К. К. Финансовая политика фирмы: Учеб. пособие / К. К. Кумехов, М. В. Петровская, Н. Ю. Сурова; под общ. Ред. К. К. Кумехова [Электронный ресурс]. – М.: Издательство «Аспект Пресс», 2019. – 208 с. - URL: <a href="https://znanium.com/catalog/product/1241379">https://znanium.com/catalog/product/1241379</a>	–	<a href="https://znanium.com">znanium.com</a>
2	Шваб, Ч. Инвестиционная революция: как мы сделали биржу доступной каждому / Чарльз Шваб; пер. с англ. [Электронный ресурс] – М.: Интеллектуальная Литература, 2020. – 220 с.	–	<a href="https://znanium.com/catalog/product/1220956">https://znanium.com/catalog/product/1220956</a>
3	Забродская, Н. Г. Предпринимательство. Организация и экономика малых предприятий: Учебник / Н. Г. Забродская [Электронный ресурс].ю - М.: ИНФРА-М, 2019. - 263 с.	Рекомендовано учебно-методическим советом ВО в качестве учебника для студентов вузов, обучающихся по направлениям подготовки 38.04.02 «Менеджмент», 38.04.01 «Экономика»	<a href="https://znanium.com/catalog/product/1000225">https://znanium.com/catalog/product/1000225</a>

### 7.3 Перечень ресурсов сети Интернет по изучаемой дисциплине

#### 7.3.1 Государственные органы Российской Федерации

- 1 <http://www.gov.ru> – Сервер государственных органов России
- 2 <http://kremlin.ru> – Официальный сайт Президента Российской Федерации.
- 3 <http://www.government.ru> – Интернет-портал Правительства Российской Федерации.
- 4 <http://www.duma.ru> – Интернет-портал Государственной Думы Федерального Собрания Российской Федерации.
- 5 <http://www.council.gov.ru> – Интернет-портал Совета Федерации Федерального Собрания Российской Федерации.

### **7.3.2 Базы экономической и финансовой информации**

- 1 <http://www.consultant.ru> – СПС «Консультант Плюс». Сервер содержит информацию о компании, выпускаемых продуктах, новые поступления документов, обзоры законодательства и много другой полезной информации.
- 2 <http://www.garant.ru> – СПС «Гарант». Справочная правовая система. Мониторинг законодательства. Новостная лента Федерального Собрания РФ. Новости МНС РФ и УМНС РФ по г. Москве. Налоговый календарь бухгалтера. Проекты законов. Новости Минюста. Новости Конституционного Суда. Публикации из журналов «Законодательство» и «Российская Юстиция». Юридический мир Интернет
- 3 <http://www.kodeks.ru> – Информационно-правовой Сервер «Кодекс».
- 4 <http://www.minfin.ru> – Интернет-портал Министерства финансов Российской Федерации.
- 5 [www.gks.ru](http://www.gks.ru) – Интернет-портал Роскомстата.
- 6 <http://www.systema.ru> – Научно-технический центр правовой информации «Система». Научно-технический центр правовой информации «Система» Федерального агентства правительственной связи и информации при Президенте Российской Федерации. Сайт предоставляет доступ к правовой базе данных, содержит электронные версии официальных изданий.
- 7 <http://www.cbr.ru> – Интернет-портал Центрального банка Российской Федерации.
- 8 <http://audit.gov.ru> – Интернет-портал Счетной палаты Российской Федерации.
- 9 <http://www.economy.gov.ru> – Интернет-портал Министерства экономического развития Российской Федерации.

### **7.3.3 Общие финансовые и экономические ресурсы, правовые каталоги.**

- 1 <http://www.olimp-msef.ru> – Интернет-портал независимой общественной организации «Молодежный союз экономистов и финансистов Российской Федерации» (МСЭФ РФ).
- 2 <http://ecsocman.edu.ru> – Федеральный образовательный интернет-портал «Экономика. Социология. Менеджмент» создан по заказу Министерства образования Российской Федерации в 2002 г. в рамках Федеральной целевой программы «Развитие единой образовательной информационной среды».
- 3 <http://www.economicus.ru> – Образовательный интернет-портал по экономике - проект Института «Экономическая Школа».
- 4 <http://www.akdi.ru/pravo/akdi> – Интернет-портал АКДИ (агентство консультаций и деловой информации) «Экономика и жизнь». Раздел «Финансы».
- 5 <http://www.bloomberg.com> – Информационный интернет-портал Bloomberg.
- 6 [www.rbk.ru](http://www.rbk.ru) – Официальный сайт РБК.
- 7 <http://www.worldbank.org> – Сайт Всемирного банка.

### **7.3.4 Тематические правовые и финансовые сайты**

- 1 <http://www.medialaw.ru> – Интернет-портал право и средства массовой информации.
- 2 WebofScience. <http://wokinfo.com/russian> – Международная реферативная база данных.
- 3 SCOPUS. <http://www.scopus.com> – Международная реферативная база данных.
- 4 <http://www.fin-izdat.ru> – Журнал «Финансы и кредит».
- 5 <http://www.e-notabene.ru> – Журнал «Финансы и управление».

### **7.3.5 Сайты некоторых экономических ВУЗов**

1 <https://www.ranepa.ru>– Официальный сайт Российской Академии народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации.

2 <http://www.mgimo.ru> – Официальный сайт Московского государственного института международных отношений.

3 <http://www.rea.ru>– Официальный сайт Российской Экономической Академии им. Г.В. Плеханова.

4 [www.fa.ru](http://www.fa.ru)– Официальный сайт Финансового университета при Правительстве Российской Федерации.

5 <http://www.stelecom.ru/iep> – Официальный сайт Института экономики и права.

6 <http://www.econ.msu.ru> – Официальный сайт Экономического факультет МГУ им. М.В. Ломоносова.

### **7.3.6 Экономические библиотеки**

1 [www.aup.ru/library](http://www.aup.ru/library)– Электронная библиотека экономической и деловой литературы.

2 <http://grebennikov.ru> – Электронная библиотека издательского дома «Гребенников» .

3 Public.Ru– Интернет-библиотека СМИ.

4 <http://www.rsl.ru> – Официальный сайт Российской государственной библиотеки.

5 <http://www.mirkin.ru> – Интернет-портал «Финансовые науки».

6 <http://www.book.ru> – Электронно-библиотечная система (ЭБС).

## **7.4 Перечень наглядных и других пособий, методических рекомендации по проведению конкретных видов учебных занятий, а также методических материалов к используемым в учебном процессе техническим средствам**

### **7.4.1 Методические рекомендации**

1. Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами. Методические рекомендации к практическим занятиям для студентов направления подготовки 38.04.08«Финансы и кредит» (электронный вариант).

ДОПОЛНЕНИЯ И ИЗМЕНЕНИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ  
(магистратура)

по дисциплине «Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами»

направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

направленность (профиль) Корпоративные финансы в цифровой экономике

на 2022-2023 учебный год

№ пп	Дополнения и изменения в	Основание
	Дополнений и изменений нет	

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры «Финансы и бухгалтерский учет»

протокол № 14 от 18.04.2022 г.

Заведующая кафедрой  
канд. экон. наук, доцент



М.С. Александрёнок

УТВЕРЖДАЮ

Декан экономического факультета  
канд. физ.-мат. наук, доцент  
22.04.2022 г.



И.И. Маковецкий

СОГЛАСОВАНО:

Ведущий библиотекарь



Начальник учебно-методического  
отдела



В.А. Кемова

« 02 » 04 2022 г.

ДОПОЛНЕНИЯ И ИЗМЕНЕНИЯ К РАБОЧЕЙ ПРОГРАММЕ ДИСЦИПЛИНЫ  
(магистратура)

по дисциплине «Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами»

направление подготовки 38.04.08 Финансы и кредит

направленность (профиль) Корпоративные финансы в цифровой экономике

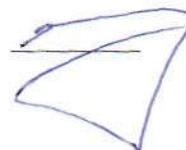
на 2023-2024 учебный год

№ пп	Дополнения и изменения в	Основание
1	п. 4.7.1 Методические рекомендации изложить в следующей редакции 1 Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами. Методические рекомендации к практическим занятиям для студентов направления подготовки 38.04.08 «Финансы и кредит» дневной и заочной форм обучения / М.С. Александрёнок, Т.В. Сидорова. – Могилев: Белорусско-Российский университет, 2022. – 27 с.	Сводный план на 2022 г.

Рабочая программа пересмотрена и одобрена на заседании кафедры «Маркетинг и менеджмент»

(протокол № 13 от 05.04.2023)

Заведующий кафедрой  
канд. экон. наук, доцент



А.В. Александров

УТВЕРЖДАЮ

Декан экономического факультета  
канд. физ.-мат. наук, доцент

06.06.2023



И.И. Маковецкий

СОГЛАСОВАНО:

Ведущий библиотекарь

Иг. О.С. Игумова

Начальник учебно-методического  
отдела



О.Е. Печковская

06.06.2023