

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 Тобины минимального риска, портфель Марковица и Тобины максимальной эффективности. | ПК-3 |
| 3 | Современные технологии формирования портфеля | Мониторинг (ревизия) и диверсификация фондового портфеля. Формирование оптимального портфеля ценных бумаг в зависимости от рисковно-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) | Часы | Практические занятия | Лабораторные занятия | | | Самостоятельная работа, часы | Форма контроля знаний |
|----------|---|------|--|----------------------|------|------|------------------------------|-----------------------|
| | | | | Часы | Часы | 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 |
| | Итого | 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») | https://znanium.com/catalog/product/1074318 |
| 2 | Дудник, Д. В. Основы финансового анализа: Учеб. пособие / Д. В. Дудник, М. Л. Шер [Электронный ресурс]. – М.: РГУП, 2020. – 232 с. | – | https://znanium.com/catalog/product/1191363 |

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: https://znanium.com/catalog/product/1241379 | – | znanium.com |
| 2 | Шваб, Ч. Инвестиционная революция: как мы сделали биржу доступной каждому / Чарльз Шваб; пер. с англ. [Электронный ресурс] – М.: Интеллектуальная Литература, 2020. – 220 с. | – | https://znanium.com/catalog/product/1220956 |
| 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» | https://znanium.com/catalog/product/1000225 |

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 – 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 – 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– 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– 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

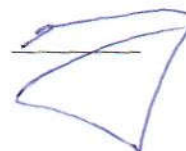
на 2023-2024 учебный год

| № 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