

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ
Пензенский филиал

Кафедра «Экономика и Финансы»

Методические указания по выполнению эссе

Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами

НАПРАВЛЕНИЕ ПОДГОТОВКИ 38.04.01 «Экономика»,
профиль Корпоративные финансы (заочная форма обучения)

Пенза 2018

Методические указания по выполнению эссе разработал:

Доцент кафедры «Экономика и финансы»
к.э.н., доцент Лескина Ольга Николаевна

Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами: методические указания по выполнению эссе для студентов, обучающихся по направлению
38.04.01 «Экономика», профиль Корпоративные финансы (заочная форма обучения)

© Пензенский филиал Финансового университета, 2018

1. Общие методические рекомендации по выполнению эссе

Основная цель выполнения эссе - сформировать у студента умение вырабатывать и корректно аргументировать свою точку зрения на решение новых задач. Эссе предполагает углубленное изучение пройденных тем, творческое осмысление современной научной литературы, материалов периодической печати и иных источников информации и овладение навыками логического изложения самостоятельных выводов и рекомендаций, направленных на решение отдельных задач и проблем фирмы.

Эссе призвана развить у студентов навыки самостоятельной научной и практической работы, творческого мышления и письменного изложения собственных мыслей, необходимых для выполнения выпускной квалификационной работы. Таким образом, помимо глубокой проработки темы, четкого лаконичного изложения сути поставленной проблемы, эссе обязательно должно содержать самостоятельный анализ и выводы по поставленной проблеме, демонстрирующие собственную позицию студента.

Структура и содержание Эссе:

- титульный лист (см. Приложение 1);
- введение - обоснование выбора объекта и предмета исследования и актуальности выбора направления исследования, его методологическую базу;
- основная часть - анализ выбранной темы с подробным изложением рассматриваемых вопросов;
- окончание - выводы по проведенному исследованию, обоснование вскрытых недостатков и перспектив развития рассмотренных положений, резюме автора по проведенному анализу; обобщение и аргументированные выводы; прогноз, в котором чётко обозначены собственные позиции автора.

Ответ на теоретический вопрос контрольной работы должен состоять из введения, основной части и заключения. Его объем не должен превышать 6 страниц машинописного текста.

В завершение Эссе должен быть приведен список использованной литературы и ссылка на используемые источники информации по общепринятым правилам.

Работа выполняется каждым студентом в письменной форме индивидуально, самостоятельно, в сроки, определенные преподавателем.

При выполнении Эссе студент, кроме рекомендуемой к изучению основной и дополнительной литературы, может использовать публикации по изучаемой теме в специальных журналах, на интернет-сайтах.

2. Роль руководителя в написании эссе

Проверку завершённой эссе осуществляет, как правило, преподаватель, который читал лекции по данной дисциплине. Он также оказывает помощь при подготовке к собеседованию.

При проверке работы преподаватель на полях делает замечания и рекомендации.

В конце эссе ставится оценка: «Допускается к собеседованию» или «Не допускается к собеседованию». В последнем случае проверяющий рекомендует студенту дополнить работу либо написать новую, если работа выполнена неудовлетворительно.

В соответствии с введённой балльно-рейтинговой системой преподаватель проставляет также на титульном листе эссе баллы за своевременную сдачу работы (до 5 баллов) и баллы за содержание работы (до 25 баллов).

3. Собеседование по эссе

На собеседовании студент должен:

- свободно ориентироваться в своём эссе;
- объяснить нахождение каждого элемента;
- ответить на все замечания преподавателя на полях;
- уметь отвечать на вопросы преподавателя по работе.

4. Рекомендации студенту:

- перед началом работы по написанию эссе необходимо согласовать с преподавателем тему, структуру, литературу, а также обсудить ключевые вопросы, которые следует раскрыть в эссе;

- представить эссе научному руководителю в письменной форме;

- выступить на семинарском занятии с 10-минутной презентацией своего эссе, ответить на вопросы студентов группы.

Требования:

- к оформлению эссе: шрифт – Times New Roman, размер шрифта - 14, межстрочный интервал - 1,5, размер полей - 2,5 см, отступ в начале абзаца - 1,25 см, форматирование по ширине; объём 10 листов; листы эссе скреплены скоросшивателем. На титульном листе указывается наименование учебного заведения, название кафедры, наименование дисциплины, тема доклада, ФИО студента;

- к структуре эссе - оглавление, введение (указывается актуальность, цель и задачи), основная часть, выводы автора, список литературы (не менее 5 позиций). Объём согласовывается с преподавателями. В конце работы ставится дата её выполнения и подпись студента, выполнившего работу.

Общая оценка за эссе учитывает содержание эссе, его презентацию, а также ответы на вопросы.

5. Тематика вопросов для подготовки эссе (внеаудиторная самостоятельная работа)

Студент самостоятельно выбирает вопрос для написания эссе из предложенного перечня и утверждает его у преподавателя. Студент вправе предложить преподавателю инициативную тему, исходя из его научных интересов и/или соответствующего вида профессиональной деятельности.

Перечень примерных тем для подготовки эссе по дисциплине «Современная портфельная теория в системе управления корпоративными финансами»

1. Формулирование инвестиционных целей при формировании инвестиционного портфеля.
2. Возможности формирования портфелей роста на фондовом рынке РФ.
3. Диверсификация в портфельном инвестировании: необходимость и подходы.
4. Использование модели Марковица при формировании инвестиционного портфеля корпорации в РФ.
5. Портфели долговых активов: возможности снижения процентного риска.
6. Комбинирование рисковых и безрисковых активов при формировании инвестиционного портфеля.
7. Арбитражные модели: факторы, влияющие на состав портфеля.
8. Возможности применения теории опционов и модели ценообразования опционов при формировании инвестиционного портфеля
9. Оценка эффективности управления инвестиционным портфелем.
10. Стили управления инвестиционным портфелем и повышение эффективности портфеля.
11. Управление инвестиционным портфелем: эффективность и издержки.
12. Возможности применения основных положений современной портфельной теории при формировании и управлении портфелем ценных бумаг корпорации в Российской Федерации.
13. Тенденции портфельных инвестиций на рынке ценных бумаг в современной России.

Методические рекомендации по работе с литературой

Любая форма самостоятельной работы студента начинается с изучения соответствующей литературы - как в библиотеке, так и дома. В каждой теме учебной дисциплины подобрана основная и дополнительная литература.

Основная литература - это учебники и учебные пособия. Дополнительная литература - это монографии, сборники научных трудов, журнальные и газетные статьи, различные справочники, энциклопедии, интернет ресурсы.

Список литературы

Нормативные акты

1. Гражданский кодекс Российской Федерации.
2. Федеральный закон Российской Федерации «Об акционерных обществах» № 208-ФЗ от 26.12.95 г.
3. Федеральный закон РФ «О рынке ценных бумаг» № 39-ФЗ от 22.04.96 г.

Рекомендуемая литература

5. Инвестиционный менеджмент: учеб. для студентов вузов, обуч. по напр. подгот. "Экономика", "Менеджмент" / под ред. Н.И. Лахметкиной; Финуниверситет. — Москва: КноРус, 2015.
6. Корпоративные финансы [Электронный ресурс]: учеб. для обуч. по программам высшего образ. напр. подгот. 38.03.01 "Экономика" / под ред. М.А. Эскиндарова, М.А. Федотовой; Финуниверситет. — Москва: Кнорус, 2016. — Режим доступа: <https://www.book.ru/book/918538/view/1>.
7. Шапкин А.С. Экономические и финансовые риски. Оценка, управление, портфель инвестиций / А.С. Шапкин, В.А. Шапкин. — 9-е изд. — Москва : Дашков и К, 2018.

Перечень ресурсов информационно-телекоммуникационной сети «Интернет»

1. Russell 3000 Index. / Russell Investments site: http://www.russell.com/indexes/data/fact_sheets/us/russell_3000_index.asp
2. Thomson Research. [Официальный сайт]. URL: <http://research.thomsonib.com/>.
3. MATLAB Product Family. / MathWorks: <http://www.mathworks.com/products/>
4. the S&P 100 Index./ Standard & Poor's: <http://www.standardandpoors.com/indices/sp-100/en/us/?indexId=spusa-100-usdof--p-us-1>
5. Информационная система Bloomberg [Официальный сайт]. URL: <http://www.bloomberg.com>
6. moex.com [Официальный сайт Московской биржи]
7. Национальная ассоциация участников фондового рынка: <http://www.naufor.ru/>
8. Инвестиции в России: куда вложить деньги?: <http://www.investmentrussia.ru/>
9. Электронная библиотека Финансового университета (ЭБ) <http://elib.fa.ru/>
<http://library.fa.ru/files/elibfa.pdf>
10. Электронно-библиотечная система BOOK.RU <http://www.book.ru>

11. Электронно-библиотечная система Znanium <http://www.znanium.com>
12. Электронно-библиотечная система издательства «ЮРАЙТ»
<https://www.biblio-online.ru/>
13. Научная электронная библиотека eLibrary.ru <http://elibrary.ru>

Образец оформления титульного листа

ФЕДЕРАЛЬНОЕ ГОСУДАРСТВЕННОЕ ОБРАЗОВАТЕЛЬНОЕ БЮДЖЕТНОЕ
УЧРЕЖДЕНИЕ ВЫСШЕГО ОБРАЗОВАНИЯ
ФИНАНСОВЫЙ УНИВЕРСИТЕТ
ПРИ ПРАВИТЕЛЬСТВЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ Пензенский
филиал

Кафедра «Экономика и финансы»

ЭССЕ

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

ВАРИАНТ № ____

Выполнил:

студент группы, формы обучения,
направления 38.04.01 «Экономика»

ФИО

Преподаватель:

степень, звание, ФИО

Пенза 20__