

Аннотация рабочей программы «ПОРТФЕЛЬНЫЙ МЕНЕДЖМЕНТ НА РЫНКЕ ЦЕННЫХ БУМАГ»

Курс «Портфельный менеджмент на рынке ценных бумаг» [Б1.В.ДВ.13] является дисциплиной по выбору вариативной части блока Б1 «Дисциплины (модули)», формирующим будущего бакалавра по направлению 38.03.02 Менеджмент в рамках подготовки направленности (профиля) программы «Антикризисный и финансовый менеджмент».

Дисциплина реализуется на факультете Экономики, менеджмента и права ЧОУ ВО «Ессентукский институт управления, бизнеса и права» кафедрой Менеджмента.

Учебная дисциплина «Портфельный менеджмент на рынке ценных бумаг» направлена на формирование целостной системы знаний о финансовых отношениях в инвестиционной деятельности, формировании портфельных инвестиций, технологии управления ценными бумагами.

Дисциплина нацелена на формирование следующих компетенций выпускника:

- Профессиональных компетенций

-умением проводить анализ рыночных и специфических рисков для принятия управленческих решений, в том числе при принятии решения об инвестировании и финансировании (ПК-15)

- владение навыками оценки инвестиционных проектов, финансового планирования и прогнозирования с учетом роли финансовых рынков и институтов (ПК-16).

Цели и задачи дисциплины: целью преподавания данной дисциплины является формирование у бакалавров прочных теоретических знаний и практических навыков в области вложений денежных средств, в различные ценные бумаги и управление ими.

Для достижения поставленной цели необходимо изучить основы портфельной теории и теории рынка капитала, научиться оперировать основными понятиями портфельного менеджмента, освоить особенности управления портфелем рискованных ценных бумаг и облигационным портфелем, а также, изучив механизм хеджирования, научиться сочетать данный метод управления рисками с основной стратегией построения портфеля ценных бумаг.

В результате освоения дисциплины студент должен:

Знать:

- структуру российского и международного рынка ценных бумаг, его место в системе финансовых рынков;

- механизм заключения сделки на российских фондовых биржах, а также позитивные и негативные стороны биржевой и внебиржевой торговли ценными бумагами;

- портфельную теорию, ее составляющие и основные модели построения оптимального портфеля.

Уметь:

- разрабатывать инвестиционную стратегию и тактику, а также осуществлять мониторинг инвестиционного портфеля;

- использовать ценные бумаги для оптимизации финансирования предприятия (организации);

- анализировать состояние фондового рынка в целом и отдельных его сегментов, составлять аналитические обзоры и прогнозы;

- рассчитывать эффективное размещение временно свободных денежных средств на рынке ценных бумаг при приемлемом соотношении риск/доходность;

Владеть:

- инструментарием портфельной теории и портфельного моделирования;

- методиками анализа финансового рынка и формирования диверсифицированного портфеля ценных бумаг;

- навыками инвестиционных расчетов.

Содержание дисциплины: в ходе изучения дисциплины раскрываются: Основы портфельного менеджмента. Ценообразование на рынке финансовых инструментов Основы

управления портфелем акций Модели формирования оптимального портфеля акций Теория и практика управления портфелем облигаций Управление портфелем производных финансовых инструментов Хеджирование портфеля ценных бумаг Мониторинг инвестиционного портфеля

Преподавание дисциплины предусматривает следующие формы организации учебного процесса: лекционные, практические занятия, решение задач, самостоятельная работа студента, консультации, инновационные формы учебных занятий.

Программой дисциплины предусмотрены следующие виды контроля: текущий контроль успеваемости в форме опроса, письменного опроса, написание докладов и рефератов по предложенным темам, выполнение контрольной работы, промежуточный контроль – в форме зачета.

Объем работ (трудоемкость) дисциплины составляет 2 зачетные единицы / 72 часа.

Для студентов заочной формы обучения программой дисциплины предусмотрены занятия лекционного типа - 4 часа, занятия семинарского типа (практические) - 10 часов и самостоятельная работа обучающегося – 54 часа, зачет – 4 часа.