

Пензенский государственный университет

Факультет экономики и управления

Аннотация рабочей программы учебной дисциплины

«Управление и оптимизация фондового портфеля»

Целью освоения учебной дисциплины (модуля) «Управление и оптимизация фондового портфеля» является формирование и углубление у бакалавров необходимого объема компетенций, в т.ч. знаний, умений и навыков о структуре, функциях, субъектах и объектах фондового рынка, современных моделях, инструментах и методах управления портфелем ценных бумаг. Данная цель реализуется путем выполнения задач: овладение теоретическими и прикладными основами управления портфелем ценных бумаг; получение необходимых знаний по определению доходности ценных бумаг, оценке и минимизации рисков портфеля ценных бумаг, диверсификации инвестиционного портфеля с учетом динамики фондового рынка и факторов риска.

Учебная дисциплина относится к вариативной части профессионального цикла Б.3 и является одной из дисциплин, формирующих знания и навыки, характерные для бакалавра по направлению подготовки 38.03.05 «Бизнес-информатика». Для изучения дисциплины необходимы базовые знания по следующим дисциплинам: «Теория вероятности», «Математическая статистика», «Математический анализ», «Экономическая теория», «Анализ и управление рисками в бизнесе», «Эконометрическое моделирование бизнес-процессов», «Экономико-математические методы принятия решений», «Эконометрика».

Предполагается, что полученные в результате изучения дисциплины «Управление и оптимизация фондового портфеля» знания будут в дальнейшем использованы для проведения научно-исследовательской работы, прохождения производственной (педагогической) и преддипломной практик,

подготовки выпускной квалификационной работы, решения задач профессиональной сферы.

Содержание учебной дисциплины «Управление и оптимизация фондового портфеля»:

Тема 1. Финансовый и фондовый рынок

Тема 2. Виды и характеристики ценных бумаг:

Тема 2.1. Облигация

Тема 2.2. Вексель

Тема 2.3. Акция

Тема 2.4. Производные финансовые инструменты

Тема 3. Фундаментальный и технический анализ рынка ценных бумаг

Тема 4. Оптимизация фондового портфеля

Тема 5. Оценка доходности и риска портфеля

Тема 6. Анализ риска портфеля, состоящего из двух и более активов.

Тема 7. Модели портфелей активов.

Тема 8. Оценка стоимости и риска активов фондового рынка.

Тема 9. Показатели эффективности управления портфелем.