

### Аннотация рабочей программы

Дисциплина «Портфельный менеджмент на рынке ценных бумаг» относится к базовой (общепрофессиональной) части профессионального цикла Б-3 дисциплин подготовки студентов по направлению подготовки Экономика и управление на предприятиях ТЭК. Дисциплина реализуется на Инженерно-экономическом факультете Самарского государственного технического университета кафедрой Экономика промышленности.

Целью освоения дисциплины «Портфельный менеджмент на рынке ценных бумаг» является формирование общекультурных и профессиональных компетенций, необходимых для реализации организационно-управленческой, информационно-аналитической и предпринимательской деятельности.

Задачи изучения дисциплины:

- получение теоретических знаний о функционировании рынка ценных бумаг;
- освоение прикладных знаний и методов портфельного менеджмента ;
- получение навыков формирования оптимального инвестиционного портфеля на рынке ценных бумаг с учетом диверсификации и хеджирования рисков.

Курс «Портфельный менеджмент на рынке ценных бумаг» призван формировать целостную картину общественных отношений, способствовать становлению высоких морально-нравственных качеств личности, развивать креативные способности студентов.

Развивающие задачи дисциплины:

- совершенствование навыков поисковой и аналитической работы;
- развитие познавательной и творческой активности.

Воспитательные задачи дисциплины:

- формирование морально-нравственных и социально-этических ориентиров;
- формирование активной жизненной позиции, патриотизма.

Дисциплина нацелена на формирование общекультурных компетенций ОК-5, ОК-10 профессиональных компетенций ПК-1, ПК-2, ПК-8, ПК-11, ПК-12, ПК-46 выпускника.

В результате изучения дисциплины студент должен:

**Знать:**

- основные виды профессиональной деятельности на РЦБ;
- организационные основы профессиональной деятельности на РЦБ;
- основы лицензирования отдельных видов профессиональной деятельности на РЦБ;
- новые направления деятельности на рынке коллективных инвестиций (хедж-фонды, фонды прямых инвестиций, траст-фонды).

**Уметь:**

- проводить анализ эффективности видов профессиональной деятельности на РЦБ;
- осуществлять расчеты доходности и надежности брокерской деятельности на основании договора поручения, договоры комиссии и агентского договора;
- оформить договор доверительного управления.

**Владеть:**

- методами расчета экономической эффективности видов профессиональной деятельности на РЦБ;
- способами оценки эффективности работы ПИФов и ОФБУ, НПФ и СО.

**Содержание дисциплины** охватывает круг вопросов, связанных с основами функционирования рынка ценных бумаг, портфельных инвестиций с использованием финансовых инструментов рынка ценных бумаг, хеджирования рисков при формировании портфельных инвестиций.

Преподавание дисциплины предусматривает следующие **формы организации учебного процесса** лекционные занятия, семинарские занятия, лекции-пресс-конференции, круглые столы,

коллоквиумы, практические занятия с разбором кейс-ситуаций и ситуационного моделирования, деловые игры-тренинги, проблемное обучение, тематические дискуссии, обзорные лекции, презентации.

Программой дисциплины предусмотрены следующие **виды контроля**: текущий контроль успеваемости в форме устных опросов, рубежный контроль в форме экзамена (27 часов) и промежуточный контроль в форме тестовых заданий и ситуационных задач.

**Общая трудоемкость освоения дисциплины** составляет 4 зачетных единиц, 144 часов. Программой дисциплины предусмотрены:

лекционные 36 часов, практические 36 часов, лабораторные занятия 18 часов и 27 часов самостоятельной работы студента.