

РОБОЧИЙ ТЕМАТИЧНИЙ ПЛАН
 навчальної дисципліни

УПРАВЛІННЯ ПОРТФЕЛЕМ ЦІННИХ ПАПЕРІВ

Обсяг годин - 120
 з них:
 Аудиторних – 38
 Консультацій – 2
 Самостійна робота – 80

Триместр викладання – IV
 Форма контролю – іспит
 Кредитів за курс – 4

Метою курсу є глибоке розуміння теорії та практики сучасного управління портфелем, заснованого на застосуванні широкого спектру математичних та статистичних методів. Основна увага приділяється ознайомленню з технічною стороною розробки оптимальної стратегії поведінки інвестора на фондовому ринку та набуття навичок щодо управління портфелем цінних паперів. В процесі навчання слухачам надається можливість практично імплементувати сучасні трейдингові стратегії, а також продемонструємо оригінальні методики гри на ринку цінних паперів.

РОЗПОДІЛ ОБСЯГУ ГОДИН

№	Найменування тем	Кількість годин		
		Усього	у тому числі	
			аудиторні	самостійні
1.	Системне управління портфелем. Концептуальні засади формування портфеля цінних паперів.	10	5	5
2.	Теорія ринку капіталу і прикладний портфельний аналіз	14	4	10
3.	Теорія арбітражної оцінки	9	4	5
4.	Види портфельних стратегій та особливості їх реалізацій.	14	4	10
5.	Управління портфелем облігацій. Оцінка ефективності портфеля облігацій.	15	5	10
6.	Стратегії використанні похідних цінних паперів як інструментів хеджування та спекулятивних операцій на ринку.	16	6	10
7.	Практичні навички формування та оцінки ефективності портфеля цінних паперів (індивідуальний проект)	26	6	20
8.	Основні проблеми і тенденції розвитку управління цінними паперами. Світова фінансова криза та її вплив на розвиток фондових ринків.	14	4	10
	Консультація	2	-	-
	Усього	120	38	80

ЛІТЕРАТУРА

1. Боди З., Меротон Р.К. Финансы: Пер. с англ. — М.: Вильямс, 2003. — 592 с.
2. Бернстайн У. Разумное распределение активов. Как построить свой портфель с максимальной доходностью и минимальным риском Переводчики: Татьяна Кублицкая, Александр Исаенков, Издательство: Манн, Иванов и Фербер, 2012.
3. Бланк И. А. Инвестиционный менеджмент: учебный курс / И. А. Бланк. — К.: Ника-Центр, 2002. — 448 с.
4. Брігхем Е. Ф. Основи фінансового менеджменту: Пер. з англ.; за наук. ред. О. Д. Василик, О. Д. Заруби. — К.: Молодь, 1997. — 998 с.
5. Лук'яненко І.Г. Оцінювання інвестицій та цінних паперів у фінансовому менеджменті: навч. посіб / І.Г. Лук'яненко.- К: НаУКМА; АграрМедіаГруп, 2012 — 227 с.
6. Bodie, Z., Kane, A. & Marcus, A. Essentials of investments. McGraw-Hill, 2008.
7. Fabozzi F. The Theory and Practice of Investment Management: Asset Allocation, Valuation, Portfolio Construction, and Strategies, Wiley, 2 edition, 2011. — 704 p.
8. Hirschey, M. & Nofsinger, J. Investments: analysis and behavior. McGraw-HillEducation, 2008.
9. Науково-теоретичні та інформаційно-практичні журнали «Банківська Справа», «Вісник Національного банку України», «Ринок цінних паперів України», «Актуальні проблеми економіки», «Бізнес-інформ».

Викладач: к.е.н., проф. О.В. Мертенс



Схвалено кафедрою: протокол №4 від «20» травня 2016 р.

Завідувач кафедри, д.е.н., професор



І.Г. Лук'яненко