Управление портфелем ценных бумаг в компании

План

ВВЕДЕНИЕ

1 ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ ВОПРОСЫ УПРАВЛЕНИЯ ПОРТФЕЛЕМ ЦЕННЫХ БУМАГ

1.1 Понятие и виды ценных бумаг

1.2 Теоретические аспекты и управление ценными бумагами

1.3 Подходы к формированию портфеля ценных бумаг

2 АНАЛИЗ ФИНАНСОВОГО СОСТОЯНИЯ И ОЦЕНКА ФИНАНСОВЫХ РЕЗУЛЬТАТОВ НА ПРИМЕРЕ ТОО «»

2.1 Особенности казахстанского фондового рынка

2.2 Характеристика деятельности предприятия

2.3 Анализ финансовых результатов

3 ФОРМИРОВАНИЕ ПОРТФЕЛЯ ЦЕННЫХ БУМАГ В ТОО «»

3.1 Формирование оптимального инвестиционного портфеля

3.2 Стратегия управления портфелем ценных бумаг

3.3 Оценка эффективности управления портфелем

ЗАКЛЮЧЕНИЕ

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ

СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ

1. Гражданский кодекс Республики Казахстан (Общая часть), принят Верховным Советом Республики Казахстан 27 декабря 1994 года (с изменениями и дополнениями по состоянию на 26.12.2012 г.)

2. Галанов В.А. Рынок ценных бумаг: Учебник / Под ред. В.А. Галанова, А.И. Басова. - 2-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2006.

3. Стародубцева Е. Б. Рынок ценных бумаг: Учебник. — М.: ИД «ФОРУМ»: ИНФРА-М, 2006

4. Жуков Е.Ф. Рынок ценных бумаг: учебник / под ред. Е.Ф. Жукова. — 3-е изд., перераб. и доп. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2009

5. Райзберг Б. А.. Курс экономики: Учебник / Под ред. Б. А. Райзберга. - 5-е изд., перераб. и доп. — ИНФРА-М., 2010

6. Фрэнк Фабоцци, Стивен Манн Справочник по ценным бумагам с фиксированной процентной ставкой, 7-е издание, том 1. Основы. Изд-во: Вильямс, 2008

7. Карташов Б. А., Матвеева Е. В., Смелова Т. А., Гаврилов А. Е. Рынок ценных бумаг (фундаментальны анализ): Учеб. пособие – ВолгГТУ, Волгоград, 2006

8. Гаврилов А. Е., Логинова В. А. Баянова Ю. А., Смелова Т. А. Рынок ценных бумаг (технический анализ): Учеб. пособие – ВолгГТУ, Волгоград, 2006

9. Батяева Т.А., Столяров И.И. Рынок ценных бумаг: Учебное пособие.- М.:ИНФРА-М, 2006

10. Бердникова Т.Б. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие. — М.: ИНФРА-М, 2002

11. Управление портфелем ценных бумаг // Интернет ресурс: http://dengifinance.ru/investicionnyi-portfel/upravlenie-portfelem-cennyh-bumag.html

12. www.afn.kz

13. www.rfca.gov.kz

14. Послание Президента РК Н.А. Назарбаева народу Казахстана «Новое десятилетие - Новый экономический подъем - Новые возможности Казахстана» от 29 января 2010 года.

15. www.primeminister.government.kz

16. Государственное регулирование рынка ценных бумаг / Интернет ресурс: http://portal.agun.kz/e-books

17. Батищева Т. Рынок нужно перезапустить / Эксперт-Казахстан, №11-12, 19.03.2012

18. Проблемы и перспективы развития фондового рынка Казахстана / Комитета по контролю и надзору финансового рынка и финансовых организаций НБ РК, октябрь 2010

19. Устав ТОО «Мицар-А»

20. Коптева Е.П. Теоретические и методологические основы формирования политики управления пассивами предприятия // Российское предпринимательство. — 2011. — № 11 Вып. 1 (195)

21. Джеймс Р. Хитчнер. Стоимость капитала / Под научн. ред. В.М. Рутгайзера. – М.: Маросейка, 2008

22. Иванов И.В., Баранов В.В. Финансовый менеджмент: стоимостной подход. Учебное пособие. – М.: Альпина Бизнес Букс, 2008

23. Ковалев В.В. Введение в финансовый менеджмент. – М.: Финансы и статистика, 2002

24. Коптева Е.П. Политика управления активами предприятия: теория и методология // Российское предпринимательство. — 2011. — № 10 Вып. 2 (194)

25. Финансовая отчетность ТОО «Мицар-А» за 2012 год

26. Зверева Е.В. Методика анализа финансового состояния деятельности субъектов малого предпринимательства собственниками организации // Вектор науки ТГУ. Серия «Экономика и управление» № 1 (8), 2012

27. Бородушко И., Васильева Э. Стратегическое планирование и контроллинг/ Интернет-ресурс http://www.nnre.ru

28. Максимова В.Ф. Инвестиционный менеджмент: Учебно-практическое пособие. - М.: Изд. центр ЕАОИ. - М., 2007

29. Брейли Р., Майерс С. Принципы корпоративных финансов/ Пер. с англ. - М.: ЗАО «Олимп – Бизнес», 2008

30. Буренин А.Н. Управление портфелем ценных бумаг. – М.: Научно-техническое общество академика Вавилова С.И., 2008

31. Кашина О. И. Проблемы практического применения теоретических и эмпирических подходов к управлению финансовыми инвестициями // Проблемы современной экономики (II): материалы междунар. заоч. науч. конф.— Челябинск: Два комсомольца, 2012

32. Аистов А.В., Ошарин А.М., Петров С.С. Сравнительный анализ критериев выбора инвестиционного портфеля на фондовом рынке с несимметричным распределением доходностей акций// Аудит и финансовый анализ. – 2011. – №3

33. Берзон Н.И., Дорошин Д.И. Особенности применения показателей эффективности финансовых инвестиций / «Финансы и кредит», №14(494), 2012

34. Бронштейн Е. М., Куреленкова Ю. В. Как измерять риск // Рынок ценных бумаг. 2006. № 12 (315)

35. Бронштейн Е.М. Формирование портфеля ценных бумаг на основе комплексных индексных мер риска. / Бронштейн Е.М., Вайнер (Шапошникова) А.Г. // Управление риском. — №1. 2010

36. Вайн С. Инвестиции и трейдинг: формирование индивидуального подхода к принятию инвестиционных решений - Москва: Альпина паблишерз, 2010

37. Грищенко Ю. И. Портфель ценных бумаг: оценка доходности и риска / «Справочник экономиста», №9 2009

38. Иванов А.П. Финансовые инвестиции на рынке ценных бумаг. – 2-е издание - М.: Издательство – торговая корпорация Дашков и Ко»,2006

39. Килячков А.А., Чалдаева Л.А. Рынок ценных бумаг и биржевое дело: Учебное пособие. 2-е изд., с изм.- М.: ЭкономистЪ, 2005

40. Киржнер Л.А., Киенко Л.П. Менеджмент организаций. - Издательство: КНТ, 2009

41. Колтынюк Б. А. Инвестиции. – СПб.: Изд-во Михайлова, 2003

42. Маренков Н.Л. Инвестиции. Серия «Учебники МГУ». Ростов н/Д: «Феникс», 2002

43. Кузнецов М.А., Авдюхин А.В. Алгоритм формирования инвестиционного портфеля на основе метода Марковица и его оптимизация по скорости выполнения // Современные проблемы науки и образования. – 2012. – № 3

44. Рухлов А. Принципы портфельного инвестирования. – Финансы. Ценные бумаги. – 2005

45. Савватеев В.В. Формирование оптимального портфеля ценных бумаг по методу Г. Марковица с помощью изучения отображения границы области дележей на плоскость «доходность – риск» / Вестник экономической интеграции. № 7, 2010

46. Селеванова Т.С. Ценные бумаги: Теория, задачи с решениями, учебные ситуации, тесты: Учебное пособие. – М.: Издательско-торговая корпорация «Дашков и Ко», 2007

47. Тертышный С.А., «Рынок ценных бумаг и методы его анализа», СПб.: Питер, 2004

48. Тинякова В.И., Ратушная Е.А. Расширенный анализ инвестиционных возможностей при формировании портфеля ценных бумаг // Современная экономика: проблемы и решения, №5(5), 2010

49. Шапошникова А. Г. (Вайнер А. Г.) Формирование оптимального портфеля ценных бумаг на основе индекса доходности портфеля // Мавлютовские чтения: сб. тр. Всерос. молодежи, науч. конф. Уфа: УГАТУ, 2008. Т. 3.

50. Шарп У.Ф. Инвестиции / Уильям Ф. Шарп, Гордон Дж. Александр, Джеффри В. Бэйли. – М.: ИНФРА-М, 2012

51. Янковский К.П. Инвестиции. – СПб.: Питер, 2006

52. http://www.kase.kz/ -Сайт Фондовой биржи РК